



Backtest #52975 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1424

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-6.61%	-0.47	33.3%	-17.84%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMZN bajo EVO_GG1RSISNIP_v1424 muestra un rendimiento negativo del 6.61% con una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica una estrategia de compra en mercados laterales. Con solo tres operaciones, los resultados carecen de significancia estadística y el drawdown del 17.84% revela una alta volatilidad de capital por evento. El ratio de Sharpe negativo confirma que el riesgo no fue compensado adecuadamente por los retornos en este periodo corto. Se requiere ampliar el intervalo de prueba a al menos 50 operaciones para validar la robustez del sistema y eliminar el ruido de muestreo. La estrategia actual no es viable para implementación real hasta que no se demuestre consistencia en un mayor volumen de datos.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-6.61%
Sortino Ratio	-0.36
Turnover	5.90x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9341.62