



Backtest #44690 · AMZN · EVO_EVOEVOEVOE_v2181

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-2.39%	-0.12	33.3%	-17.43%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMZN con EVO_EVOEVOEVOE_v2181 muestra un rendimiento negativo del -2.39% y una caída máxima del 17.43%, lo que indica una ineficiencia crítica en la gestión de riesgo durante la simulación. La tasa de éxito del 33.3% basada en solo tres operaciones es estadísticamente insignificante y carece de poder para validar la estrategia bajo condiciones de mercado reales. La relación de Sharpe negativa de -0.12 confirma que el riesgo asumido no fue compensado por los retornos esperados en este periodo limitado de prueba. El principal fallo radica en la falta de robustez del modelo para filtrar movimientos laterales o evitar entradas prematuras con un volumen de datos insuficiente. Como siguiente paso concreto, es necesario aumentar el tamaño de

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-2.39%
Sortino Ratio	-0.09
Turnover	5.94x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9763.47