



Backtest #50718 · AMZN · EVO_EVOEVOEVOE_v2047

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-4.83%	-0.32	33.3%	-17.43%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMZN bajo la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2047 muestra una ineficacia clara con un ROI negativo del -4.83% y una caída máxima del 17.43%, lo que indica una gestión de riesgo inadecuada en este activo. La baja tasa de acierto del 33.3% junto con un ratio de Sharpe de -0.32 sugiere que la lógica de entrada genera más pérdidas que ganancias en el corto plazo. La muestra de solo tres operaciones es estadísticamente insuficiente para confirmar patrones, pero los resultados actuales son consistentemente negativos y no sostenibles. La siguiente acción es ajustar los filtros de entrada para reducir la exposición durante movimientos laterales o revertir la lógica de salida. Este escenario no representa un activo viable bajo la

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.83%
Sortino Ratio	-0.25
Turnover	5.92x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9520.29