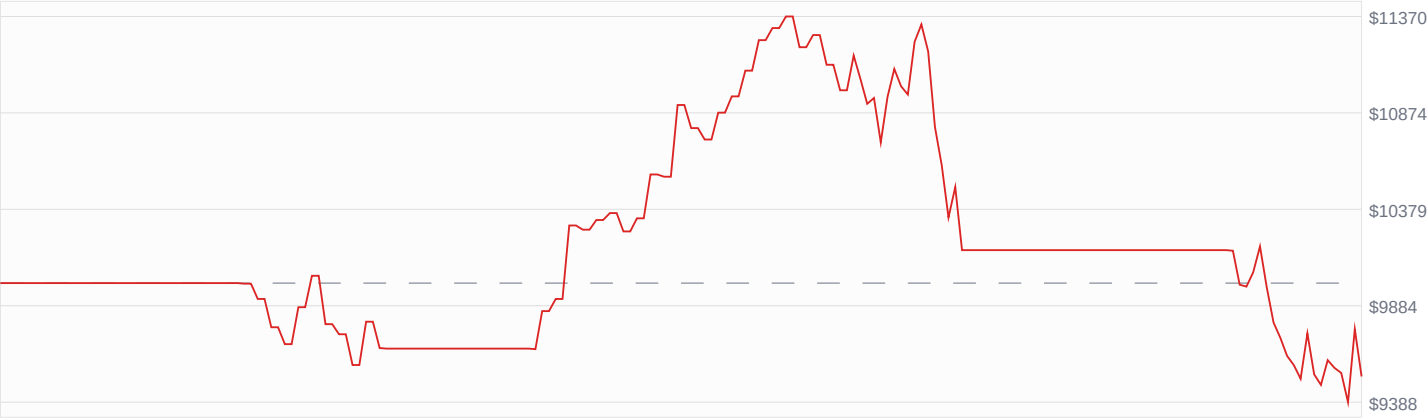




Backtest #51174 · AMZN · EVO\_EVOEVOEVOE\_v561

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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

La estrategia EVO\_EVOEVOEVOE\_v561 sobre AMZN falló catastróficamente con un retorno negativo del 4.83% y una tasa de ganancia de solo 33.3%, lo que indica una incapacidad de capitalizar la tendencia o gestionar el riesgo. La relación de Sharpe de -0.32 confirma que el rendimiento fue peor que el mercado libre, mientras que el drawdown máximo del 17.43% sugiere una exposición excesiva durante los pocos intentos de mercado. Con solo tres operaciones registradas, la muestra es demasiado pequeña para generar confianza estadística en cualquier conclusión sobre la robustez del modelo. El siguiente paso crítico es auditar la lógica de entrada para entender si el sistema está sobreajustado a ruido o fallando en la detección de tendencias. Se requiere un

ADDITIONAL METRICS

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