



Backtest #55049 · AMZN · EVO_EVOEVOEVOE_v1936

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 con la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1936 presenta un desempeño negativo, con una rentabilidad del -6.61% y un ratio de Sharpe de -0.47, indicando que el riesgo no fue compensado adecuadamente por los retornos. Con solo tres operaciones, el resultado muestra una baja confianza estadística y es insuficiente para inferir la viabilidad real del modelo, donde el 33.3% de tasa de aciertos y un máximo de caída del 17.84% sugieren una alta sensibilidad al ruido de mercado. La estrategia parece haber fallado en filtrar las condiciones adversas específicas de este activo en el periodo analizado. Se requiere ampliar el historial de pruebas a al menos 100 operaciones o ajustar los parámetros de entrada para evaluar si el diseño es

ADDITIONAL METRICS

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