



Backtest #27583 · AMZN · EVO_EVOEVOEVOE_v569

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-12.04%	-0.94	33.3%	-17.14%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v569 aplicada a AMZN presenta un perfil de riesgo desalineado con los objetivos institucionales. Un ROI negativo del -12.04% combinado con un Sharpe de -0.94 confirma que el riesgo asumido no genera compensación estadística. La tasa de aciertos del 33.3% sobre apenas 3 operaciones carece de validez muestral; no puede distinguirse el rendimiento del azar. El drawdown máximo del 17.14% excede el umbral típico de control para estrategias cuantitativas. El siguiente paso obligatorio es ampliar el backtest a un universo temporal mínimo de 200 operaciones para validar la robustez del alpha antes de cualquier iteración.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-12.04%
Sortino Ratio	-0.59
Turnover	5.28x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8796.05