



Backtest #31039 · AMZN · EVO_EVOEVOEVOE_v800

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_v800 mostró un rendimiento negativo con una ROI de -12.04% en 3 trades, lo cual indica una falta de eficacia en el mercado. El Sharpe ratio negativo de -0.94 sugiere que el riesgo no fue compensado por el retorno obtenido. Con solo 3 operaciones, la muestra es muy pequeña para confiar en los resultados, lo que limita la confianza estadística. El máximo drawdown del 17.14% revela altos riesgos sin una cobertura adecuada. Se debe aumentar la muestra de backtest a al menos 50 trades antes de considerar su implementación en producción.

ADDITIONAL METRICS

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