



Backtest #31040 · 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_EVOEVOEVO_v800 presentó un rendimiento negativo del 12.04% en AMZN, con una relación Sharpe de -0.94, indicando que el riesgo no fue compensado adecuadamente. El ratio de ganancia del 33.3% y solo 3 operaciones limitan la confianza estadística. El máximo drawdown del 17.14% revela una alta volatilidad sin control. La falta de consistencia en la señalización hace que el modelo sea inestable. Revisar el umbral de confianza del detector de señales podría mejorar la precisión de los señales. La estrategia necesita una optimización de parámetros para mejorar su robustez.

ADDITIONAL METRICS

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