



Backtest #32981 · AMZN · EVO\_WEBIDEA\_v50

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

El backtest de EVO\_WEBIDEA\_v50 en AMZN muestra una ROI negativa del -12.04% con un Sharpe de -0.94, indicando una gestión de riesgo deficiente. Solo 3 operaciones generaron una ganancia del 33.3%, pero el drawdown máximo del 17.14% sugiere volatilidad alta. La muestra extremadamente pequeña (3 trades) limita la confiabilidad estadística. La estrategia no logra justificar su riesgo asumido. Next step: expandir el backtest a un período más largo para validar resultados.

ADDITIONAL METRICS

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