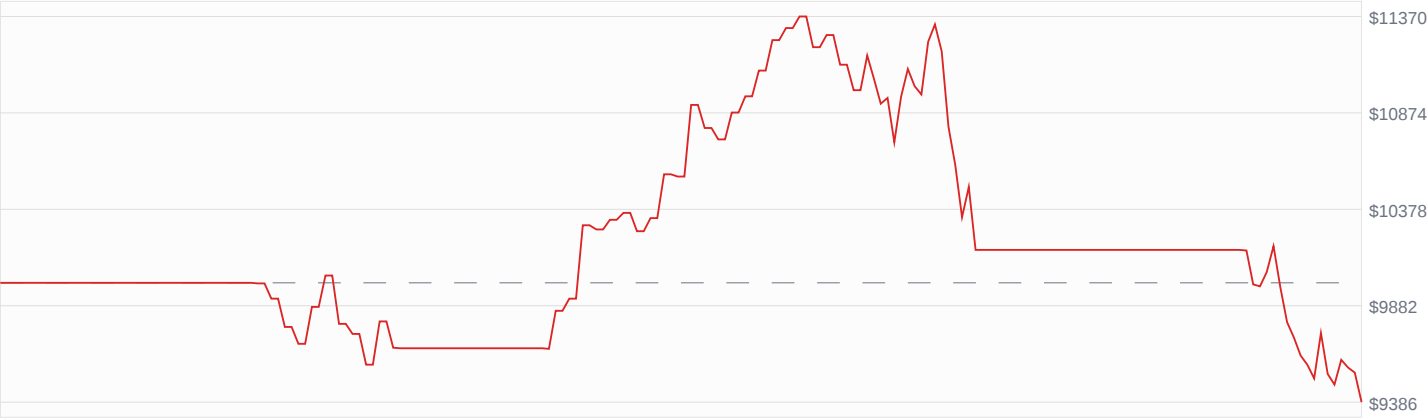




Backtest #37362 · AMZN · EVO_WEBIDEA_v45

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-6.16%	-0.48	33.3%	-17.44%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_WEBIDEA_v45 falló en el activo AMZN con un ROI negativo del 6.16% y una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica una incapacidad sistémica para capturar tendencias en este periodo. Un máximo de 3 operaciones muestra un sesgo de muestra crítico que invalida cualquier métrica de Sharpe negativa o el drawdown del 17.44% como indicadores de riesgo estadístico fiables. No hay evidencia suficiente para confirmar la robustez del modelo, ya que tres ejecuciones no permiten distinguir entre ruido del mercado y una lógica de señal defectuosa. La siguiente acción prioritaria es ampliar el periodo de retrotesteo o ajustar los parámetros de entrada para filtrar mejor la volatilidad específica de Amazon antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-6.16%
Sortino Ratio	-0.35
Turnover	5.91x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9386.33