



Backtest #50989 · AMZN · EVO_EVOEVOEVOG_v476

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-4.83%	-0.32	33.3%	-17.43%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOG_v476 sobre AMZN mostró una ineficiencia crítica con un retorno negativo del 4.83% y una tasa de ganancia del 33.3%. Solo tres operaciones limitan severamente la validez estadística de cualquier conclusión sobre la robustez del modelo. Un drawdown máximo del 17.43% indica que la gestión de riesgos falló al no proteger el capital durante la tendencia adversa. Se debe ejecutar una nueva simulación con al menos 100 operaciones para distinguir entre ruido aleatorio y fallos estructurales del algoritmo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.83%
Sortino Ratio	-0.25
Turnover	5.92x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9520.29