



Backtest #55425 · AMZN · EVO_EVOEVOEVOE_v2405

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-6.61%	-0.47	33.3%	-17.84%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMZN para la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2405 muestra una ineficiencia crítica con un retorno negativo del 6.61% y una tasa de éxito del 33.3% sobre solo tres operaciones. La baja muestra estadística invalida cualquier conclusión robusta, ya que un pequeño número de trades amplifica el impacto de la varianza aleatoria sobre las métricas de desempeño. El drawdown máximo del 17.84% sugiere que la estrategia carece de suficientes filtros de protección en condiciones de mercado laterales. Se requiere aumentar el intervalo de tiempo para generar un dataset más amplio y validar la robustez del modelo antes de considerar ajustes.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-6.61%
Sortino Ratio	-0.36
Turnover	5.90x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9341.62