



Backtest #46637 · TSLA · EVO_GG1RSISNIP_v321

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-3.15%	-0.09	0.0%	-15.69%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v321 falló drásticamente en TSLA con una pérdida neta del 3.15% y una rentabilidad ajustada al riesgo negativa (Sharpe: -0.09). El único trade ejecutado resultó en una pérdida, indicando que el filtro de entrada fue ineficaz o mal configurado. Con solo un trade, la muestra es demasiado pequeña para afirmar con confianza la viabilidad del modelo. La alta drawdown del 15.69% sugiere que el sistema carece de gestión de riesgo adecuada. Se recomienda ajustar los parámetros de entrada y validar el modelo con al menos 20 trades antes de considerar una implementación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-3.15%
Sortino Ratio	-0.05
Turnover	1.97x
Total Trades	1
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9685.03