



Backtest #51353 · TSLA · EVO\_GG1RSISNIP\_v1471

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

El backtest de TSLA con EVO\_GG1RSISNIP\_v1471 muestra una ejecución fallida con una tasa de éxito del 0% y una pérdida del 3.15% en un solo trade. La estrategia falló al entrar en un mercado sin confirmación, resultando en un máximo de caída del 15.69% y una relación de Sharpe negativa que indica un rendimiento inferior al riesgo libre. Con solo una transacción, la muestra es estadísticamente insuficiente para validar la lógica del sistema o calcular la significancia del resultado. La falta de un filtro de tendencia clara sugiere que el algoritmo opera ciegamente en rangos laterales. El paso inmediato debe ser ajustar los umbrales de entrada para requerir confirmación de volumen o rompimiento de rango antes de ejecutar.

ADDITIONAL METRICS

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