



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  |