



Backtest #53004 · TSLA · EVO\_EVOEVOE\_v1886

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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 EVO\_EVOEVOE\_v1886 en TSLA revela un desempeño crítico con un único trade que generó una pérdida del 3.15%, resultando en una tasa de ganancia del 0% y un ratio de Sharpe negativo de -0.09. El drawdown máximo del 15.69% indica una exposición extrema a la volatilidad sin mecanismos de protección efectivos, lo que sugiere una lógica de entrada o salida mal calibrada para este activo específico. Dada la muestra de solo una operación, los resultados estadísticos son insuficientes para confirmar la viabilidad de la estrategia y carecen de cualquier confianza significativa para la implementación institucional. La ausencia total de operaciones ganadoras implica que los umbrales de activación o los filtros de confirmación están

ADDITIONAL METRICS

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