



Backtest #53311 · TSLA · EVO\_EVOEVOEVOE\_v1729

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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 para EVO\_EVOEVOEVOE\_v1729 muestra un rendimiento negativo del 3.15% con una tasa de éxito del 0% tras una sola operación, lo que invalida cualquier conclusión estadística debido al tamaño de muestra insuficiente. La estrategia falló en filtrar el ruido del mercado, resultando en una caída máxima del capital del 15.69% sin generar beneficios, lo que sugiere una lógica de entrada demasiado agresiva para la volatilidad actual. Con solo un trade ejecutado, los indicadores como el ratio de Sharpe de -0.09 carecen de significado predictivo y no pueden validar la robustez del modelo. Es imperativo ejecutar una prueba de estrés con datos históricos extendidos para identificar si el fallo es estructural o aleatorio antes de cualquier

ADDITIONAL METRICS

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