



Backtest #30585 · TSLA · EVO_GG1RSISNIP_v405

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_v405 presentó un desempeño defensivo en TSLA con una pérdida del 3.15% y una baja tasa de ganancia del 0%, lo cual se debe principalmente a una única operación que resultó en un drawdown máximo del 15.69%. La baja cantidad de operaciones (n=1) limita la confianza estadística, por lo que el análisis carece de robustez para conclusiones sólidas. Se recomienda realizar una simulación adicional con al menos 20 operaciones para validar la estrategia antes de considerarla para uso en producción. El ratio de Sharpe negativo de -0.09 indica que el riesgo no fue compensado adecuadamente en esta prueba, lo cual es una señal de alerta para futuras implementaciones.

ADDITIONAL METRICS

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