



Backtest #30889 · TSLA · EVO\_GG1RSISNIP\_v101

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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\_v101 mostró rendimiento negativo con TSLA, generando un ROI de -3.15% y Sharpe ratio de -0.09, con una tasa de ganancia del 0.0% y un drawdown máximo del 15.69%. El número de operaciones fue insuficiente para validar estadísticamente la confianza del modelo. Se recomienda aumentar el volumen de backtests a más de 20 operaciones para evaluar la robustez del algoritmo de señales. La estrategia requiere ajustes en su lógica de entrada.

ADDITIONAL METRICS

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