



Backtest #31018 · TSLA · EVO_GG1RSISNIP_v143

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_v143 falló rotundamente en TSLA, con un ROI negativo del -3.15% y una tasa de ganancia del 0.0%, lo que indica una falta de capacidad de captura de tendencias. El Sharpe negativo (-0.09) sugiere que el riesgo no fue compensado por el retorno, y el único trade realizado refleja una muestra insuficiente para una evaluación estadísticamente significativa. El máximo drawdown del 15.69% revela una exposición de riesgo significativa sin compensación. La estrategia necesita una optimización de parámetros para ajustar el umbral del RSI y reevaluar la ventana de tiempo de los cruces de media móvil. La próxima fase debe incluir una simulación más robusta con al menos 20 operaciones para validar su viabilidad.

ADDITIONAL METRICS

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