



Backtest #31621 · TSLA · EVO_GG1RSISNIP_v380

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 con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v380 revela un rendimiento negativo con una ROI de -3.15% y una tasa de ganancia del 0.0%, lo cual indica una falta de consistencia en las seales generadas. La baja confianza estadística se debe a solo una operación realizada, lo que limita la capacidad de generalizar el desempeño. Se recomienda ajustar los parámetros de entrada de la estrategia para mejorar la detección de tendencias y aumentar el tamaño de muestra para pruebas futuras. La alta pérdida máxima del 15.69% sugiere la necesidad de implementar un sistema de gestión de riesgos más robusto. El Sharpe ratio negativo de -0.09 confirma que el retorno no compensa el riesgo asumido.

ADDITIONAL METRICS

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