



Backtest #34104 · TSLA · EVO\_EVOEVOEVOE\_v715

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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\_EVOEVOEVOE\_v715 falló completamente en TSLA, registrando una pérdida del 3.15% con un ratio de Sharpe negativo y una tasa de acierto del 0% en un único comercio. La estadística muestra nula confianza dada la muestra de un solo trade, lo que invalida cualquier conclusión sobre la robustez del modelo. El drawdown del 15.69% sugiere que la lógica de salida fue ineficaz o inexistente bajo las condiciones de mercado analizadas. Como paso siguiente, se requiere un backtest extendido con mayor frecuencia y volumen para validar o descartar la premisa del algoritmo. No se recomienda la implementación inmediata hasta que la métrica de acierto supere el umbral de viabilidad operativa.

ADDITIONAL METRICS

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