



Backtest #37577 · TSLA · EVO_GG1RSISNIP_v275

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 para la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v275 muestra una ineficacia total con un win rate del 0% y solo una ejecución, lo que indica un fallo absoluto de señal o un error de parametrización. La caída del capital al 96.85% y una ratio de Sharpe negativa de 0.09 confirman que el riesgo no fue compensado por ningún retorno, mientras que el máximo drawdown del 15.69% revela una exposición desproporcionada ante un solo movimiento adverso. Esta muestra de tamaño uno carece de cualquier poder estadístico para validar la viabilidad del algoritmo en mercados reales. Es imperativo ejecutar una nueva simulación con al menos 100 operaciones y ajustar los umbrales de entrada para evitar la liquidación por un solo evento. La estrategia en su estado

ADDITIONAL METRICS

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