



Backtest #47147 · TSLA · EVO_WEBIDEA_v140

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_WEBIDEA_v140 sobre TSLA falló catastrófica al registrar una ganancia negativa del 3.15% y una tasa de éxito del 0% tras únicamente una operación. Un ratio de Sharpe de -0.09 y un máximo de caída del 15.69% indican una exposición al riesgo inaceptable sin capacidad de generar alfa. Con solo una transacción ejecutada, los resultados carecen de potencia estadística para validar la lógica subyacente del sistema. La muestra es insuficiente para descartar el modelo o atribuir el fallo a condiciones de mercado anómalas. El siguiente paso obligatorio es ejecutar un backtest de estrés con datos de mayor volumen para evaluar la robustez del algoritmo.

ADDITIONAL METRICS

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