



Backtest #53312 · TSLA · EVO_EVOEVOE_v1729

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_EVOEVOE_v1729 en TSLA falló completamente, ejecutando una sola operación con una tasa de acierto del 0% y una caída máxima del 16.7% que devolvió el capital final a \$9,685. Un Sharpe ratio negativo de -0.09 y un ROI de -3.15% confirman que el parámetro actual no genera valor, probablemente debido a un umbral de entrada demasiado agresivo en un entorno lateral. Con solo un trade en la muestra, cualquier conclusión estadística es altamente inconfiable y carece de poder para validar la robustez del modelo. El siguiente paso crítico es ampliar el período de backtesting a al menos 500 operaciones o reducir el tamaño de posición antes de considerar cualquier reactivación.

ADDITIONAL METRICS

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