



Backtest #51806 · VOXR · EVO\_GG1RSISNIP\_v257

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -2.01% | -0.05  | 33.3%    | -11.32%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v257 en VOXR muestra ineficiencia crítica con un ROI negativo del -2.01% y una tasa de ganancia de solo 33.3%. El bajo número de operaciones totales, tres en este caso, limita severamente la confianza estadística de los resultados y el ratio de Sharpe negativo de -0.05 indica una tendencia a la baja inestable. Un drawdown máximo del 11.32% sugiere que la gestión de riesgo actual no protege el capital en mercados laterales o de alta volatilidad. La falta de consistencia en la toma de señales hace imposible validar la robustez del modelo sin más datos. Como siguiente paso concreto, ejecutar una serie de 100 operaciones simuladas para evaluar la estabilidad del algoritmo bajo condiciones de mercado extendidas.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -2.01%    |
| Sortino Ratio   | -0.02     |
| Turnover        | 5.70x     |
| Total Trades    | 3         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$9801.86 |