



SCHEDA BACKTEST

BOT ETH/USDC (SPOT)

Periodo: 2022 - 2025

IMPORTANTE: I risultati mostrati sono frutto di simulazioni storiche e **non garantiscono** rendimenti futuri.

1. PANORAMICA DEL BACKTEST

Questa scheda riassume il backtest del bot **ETH/USDC** su mercato **spot**, con capitale iniziale di 10.000 USDT. La strategia è di tipo *swing trading quantitativo*: individua fasi di eccesso (pullback o inversioni) e opera senza leva.

- **Periodo analizzato:** 19 Giugno 2022 – 18 Gennaio 2025 (circa 943 giorni)
- **Capitale iniziale:** 10.000 USDT
- **Capitale finale:** 13.568,50 USDT
- **Rendimento complessivo:** +35,69%
- **Rendimento annualizzato:** 13,81%

2. METRICHE PRINCIPALI

Su tutto il periodo il bot ha eseguito **87 trade**. Di seguito i dettagli statistici:

Numero totale di trade	87
Win Rate	51,72%
Profit Factor	1,54
Max Drawdown	12,80%
Rendimento medio per trade	1,33%
Gain medio trade vincente	6,93%
Perdita media trade perdente	4,68%
Sharpe Ratio	7,37
Recovery Factor	2,79

*Profit Factor > 1 indica che i profitti totali superano le perdite totali.

3. LOGICA DELLA STRATEGIA

La strategia si basa su tre pilastri fondamentali:

1. **Filtri di Trend:** Il bot opera preferibilmente quando ETH si muove in modo direzionale, riducendo l'operatività nelle fasi laterali o caotiche.
2. **Ingressi su segnali tecnici:** Utilizzo di oscillatori e volatilità per individuare zone statisticamente favorevoli.
3. **Gestione del rischio:** Stop loss codificato in funzione della volatilità, nessuna leva finanziaria, e trailing stop per lasciar correre i profitti.

4. COMPORTAMENTO OSSERVATO

Dall'analisi su 943 giorni emergono queste caratteristiche:

- **Fasi di Trend:** Nei periodi rialzisti, il bot cattura movimenti ampi generando la maggior parte del rendimento.
- **Fasi Lateraliali:** I risultati possono essere modesti con possibili sequenze di stop loss (parte della normale statistica).
- **Frequenza:** Il bot non opera continuamente. Alcune settimane possono non avere trade.

5. RISCHI, LIMITI E DISCLAIMER

- I risultati si basano su dati storici (2022-2025) e non possono replicare perfettamente slippage o problemi di liquidità reali.
- Il capitale investito è a rischio. Drawdown futuri potrebbero differire da quelli testati.
- **Target utente:** Investitori con orizzonte medio-lungo periodo che accettano la volatilità del mercato crypto.

6. CONTENUTO DEL PACCHETTO

Il download include:

- Questa scheda riassuntiva (.md / .pdf).
- Immagine dell'Equity Curve.
- File JSON con metriche tecniche per analisti.

EQUITY CURVE (Grafico)

