

Scheda Backtest – Bot ETH/USDC (2022–2025)

Questa scheda riassume il backtest del bot **ETH/USDC** su mercato **spot**, eseguito sul periodo 2022-06-19 – 2025-01-18 con capitale iniziale di 10.000 USDT. L'obiettivo è fornire ai clienti una panoramica chiara e trasparente delle prestazioni storiche della strategia (backtest).

> **Importante:** i risultati mostrati sono frutto di simulazioni storiche e **non garantiscono** rendimenti futuri.

1. Panoramica del backtest

- **Coppia operata:** ETH/USDC (spot) - **Periodo analizzato:** 2022-06-19 – 2025-01-18 - **Capitale iniziale:** 10 000 USDT - **Capitale finale:** 13 568.50 USDT - **Rendimento complessivo:** 35.69% - **Rendimento annualizzato:** 13.81%

La strategia è di tipo **swing trading quantitativo**: il bot utilizza indicatori tecnici per individuare fasi di eccesso (pullback o inversioni) su Ethereum e apre posizioni con gestione del rischio codificata, senza leva e solo su mercato spot.

2. Metriche principali

| Metrica | Valore | |-----|-----|

| 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 |

Su tutto il periodo il bot ha eseguito **87 trade**, con una quota di operazioni vincenti di circa **51.72%** e profitti mediamente più grandi delle perdite, come mostrato dal **profit factor > 1**.

3. Logica della strategia (alto livello)

Senza entrare nei dettagli proprietari della formula, la strategia si basa su tre pilastri principali:

1. **Filtri di trend:** il bot opera preferibilmente quando il prezzo di ETH si muove in modo direzionale, riducendo l'operatività nelle fasi altamente laterali o caotiche. 2.

Ingressi su segnali tecnici: vengono utilizzati indicatori quantitativi (es. oscillatori e misure di volatilità) per individuare zone statisticamente favorevoli all'apertura di posizione. 3. **Gestione del rischio e delle uscite:** - stop loss

codificato in funzione della volatilità, - nessuna leva, - possibilità di lasciare correre i profitti tramite meccanismi di trailing/uscita condizionata.

In questo modo la strategia cerca un equilibrio tra: - protezione del capitale nelle fasi avverse, - partecipazione ai trend rialzisti di ETH, - numero di trade sufficiente per dare significato statistico ai risultati.

4. Comportamento osservato nel backtest

Dal backtest su circa **943 giorni** emergono alcune caratteristiche:

- Nei periodi di **forte trend** (soprattutto rialzista), il bot tende a catturare

movimenti ampi e contribuisce in modo significativo al rendimento totale. - Nelle fasi **correttive o laterali**, i risultati possono essere più modesti e sono possibili

sequenze di trade in perdita; ciò rientra nella normale dinamica statistica della

strategia. - Il **drawdown massimo storico** nel backtest è intorno a **12.80%**, in linea

con una strategia moderata su singolo asset crypto senza leva.

È importante notare che: - il bot ****non opera continuamente****: alcune settimane potrebbero non avere trade, - esistono ****mesi negativi o poco profittevoli****, compensati da periodi più favorevoli, - la performance complessiva è fortemente legata ai cicli di prezzo di Ethereum.

5. Rischi, limiti e disclaimer

- I risultati sono basati su un ****backtest storico**** sul periodo 2022–2025 e includono solo le condizioni di mercato osservate in quel periodo. - Il backtest ****non può riprodurre perfettamente**** tutte le condizioni reali (slippage, variazioni di liquidità, delay di esecuzione, problemi tecnici, ecc.). - Rendimenti passati o simulati ****non garantiscono**** risultati futuri: mercati futuri potrebbero essere molto diversi da quelli del periodo testato. - Il capitale investito è sempre a ****rischio****: drawdown futuri potrebbero superare quelli osservati in backtest.

Questo bot è pensato per utenti che: - comprendono i rischi del mercato crypto, - vogliono esporsi specificamente a ****Ethereum**** tramite una strategia sistematica, - hanno un orizzonte temporale di ****medio–lungo periodo**** e accettano fasi di volatilità del capitale.

6. Contenuto del pacchetto

Il pacchetto scaricabile include:

- Questa scheda di ****riassunto del backtest**** in formato Markdown (`.md`). - L'immagine dell'****equity curve**** con andamento del capitale nel periodo (EquityCurve_ETHUSDC_2022-2025.png). - Un file JSON con le ****metriche chiave**** del backtest per uso tecnico / analitico.

Per qualsiasi dubbio interpretativo sulle metriche o sul funzionamento del bot, si consiglia di contattare il supporto prima dell'utilizzo in reale.

Scheda Riassuntiva del Backtest: Bot di Swing Trading Quantitativo ETH/USDC (2022–2025)

Obiettivo: Fornire una visione chiara e trasparente delle prestazioni storiche (backtest) della strategia ETH/USDC (mercato spot) ai potenziali clienti.-----1. Dettagli del Backtest

Parametro	Dettaglio
Coppia Operata	ETH/USDC (Spot, 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%

Strategia: Il bot adotta una logica di **swing trading quantitativo**. Utilizza indicatori tecnici avanzati per identificare momenti di eccesso di mercato (pullback o inversioni) su Ethereum,

aprendo posizioni con una rigorosa gestione del rischio codificata.-----2. Metriche di Performance

Le 87 operazioni eseguite durante il periodo di test hanno prodotto i seguenti risultati:

Metrica	Risultato	Dettaglio
Numero Totale di Trade	87	Numero di operazioni completate.
Win Rate	51,72%	Percentuale di trade vincenti.
Profit Factor	1,54	Il guadagno totale è 1,54 volte superiore alla perdita totale.
Max Drawdown	12,80%	Massima perdita percentuale registrata dal picco al fondo.
Rendimento Medio per Trade	1,33%	Guadagno medio per singola operazione.
Gain Medio Trade Vincente	6,93%	Guadagno medio delle sole operazioni positive.
Perdita Media Trade Perdente	4,68%	Perdita media delle sole operazioni negative.
Sharpe Ratio	7,37	Misura della performance aggiustata per il rischio.
Recovery Factor	2,79	Misura la capacità di recuperare dal Max Drawdown.

Il **Profit Factor (> 1)** indica che la strategia ha generato profitti mediamente superiori alle perdite.-----3. Logica Operativa (Sintesi)

La strategia si basa su tre principi fondamentali:

1. **Filtri di Trend:** Il bot opera prevalentemente quando il prezzo di ETH mostra una chiara direzionalità, limitando l'operatività nelle fasi di mercato lateralizzate o caotiche.
2. **Ingressi Tecnici:** Utilizzo di oscillatori e misure di volatilità per individuare zone statisticamente favorevoli per l'apertura delle posizioni.
3. **Gestione del Rischio:**
 - Stop Loss dinamico basato sulla volatilità.
 - Assenza di leva (solo mercato spot).
 - Meccanismi per il mantenimento dei profitti (es. trailing stop).

L'obiettivo è bilanciare la protezione del capitale, la partecipazione ai trend di Ethereum e garantire una base statistica solida con un numero adeguato di trade.-----4. Note Comportamentali

- **Periodi di Trend:** Nei mercati fortemente direzionali (soprattutto rialzisti), il bot tende a realizzare i guadagni più significativi.
- **Fasi Correttive/Laterali:** In queste fasi, i risultati possono essere inferiori e sono statisticamente possibili sequenze di perdite.
- **Operatività:** Il bot non opera costantemente; possono esserci settimane senza trade. Esistono mesi a rendimento negativo o nullo, compensati da periodi più favorevoli.
- **Rischio:** Il **Drawdown Massimo Storico (12,80%)** è contenuto per una strategia crypto su singolo asset senza leva.

-----5. Avvertenze e Disclaimer Importanti

ATTENZIONE: I risultati presentati sono il frutto di simulazioni storiche e **non costituiscono in alcun modo una garanzia di rendimenti futuri.**

- **Rischio di Mercato:** Il capitale investito è soggetto a rischio. Drawdown futuri potrebbero essere superiori a quelli osservati in backtest.
- **Limiti del Backtest:** La simulazione storica non può replicare perfettamente tutte le condizioni reali del mercato (es. slippage, liquidità, latenze di esecuzione).
- **Profilo Utente Ideale:** La strategia è pensata per utenti che:
 - Sono consapevoli e accettano i rischi del mercato crypto.
 - Cercano un'esposizione sistematica a Ethereum.
 - Hanno un orizzonte di investimento a **medio-lungo periodo**.

-----6. Contenuto del Pacchetto

Il pacchetto del bot include:

- Questa scheda di riassunto del backtest (formato **.md**).
- L'immagine dell'**equity curve** (grafico dell'andamento del capitale).
- Un file JSON con le metriche chiave per analisi tecniche.

Si raccomanda di contattare il supporto in caso di dubbi prima di qualsiasi utilizzo in tempo reale.

