



SCHEDA BACKTEST

BOT BTC/USDC (SPOT)

Periodo: 2023 - 2024

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 **BTC/USDC** su mercato **spot**, eseguito sul periodo Gennaio 2023 – Dicembre 2024 (2 anni). La strategia è di tipo *trend-following su pullback*: entra a mercato correzioni in un trend rialzista e gestisce il rischio tramite volatilità.

- **Periodo analizzato:** 01/01/2023 – 31/12/2024
- **Capitale iniziale:** 10.000 USDT
- **Capitale finale:** 13.934,25 USDT
- **Rendimento complessivo:** +39,34%
- **Rendimento annualizzato:** 20,20%

2. METRICHE PRINCIPALI

Su tutto il periodo il bot ha eseguito **63 trade** (media 31-32 l'anno). Di seguito i dettagli statistici:

Numero totale di trade	63
Win Rate	54,0%
Profit Factor	2,08
Max Drawdown	6,73%
Rendimento medio per trade	1,97%
Gain medio trade vincente	6,71%
Perdita media trade perdente	3,58%
Sharpe Ratio	13,22
Recovery Factor	15,85

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

3. LOGICA DELLA STRATEGIA

La strategia utilizza una combinazione di indicatori per selezionare ingressi ad alta probabilità:

1. **RSI (Pullback):** Il bot entra quando l'RSI segnala un pullback controllato (zona di iper-venduto relativo) all'interno di un trend rialzista.
2. **Supertrend Filter:** Usato come filtro direzionale per operare **solo a favore del trend principale**, evitando fasi laterali ribassiste.
3. **Gestione Volatilità (ATR):**
 - Stop Loss posizionato in base all'ATR (circa $3.0 \times ATR$).
 - Trailing Stop dinamico (circa $3.5 \times ATR$) per lasciar correre i profitti (nessun Take Profit fisso).

4. COMPORTAMENTO OSSERVATO

Dall'analisi su 2 anni di dati (2023-2024) emergono queste caratteristiche:

- **Trend Rialzista:** Il bot genera la maggior parte dei profitti lasciando correre i movimenti direzionali grazie al trailing stop.
- **Mercato Laterale:** La strategia diventa conservativa; il numero di operazioni resta limitato per preservare il capitale.
- **Drawdown:** Il Max Drawdown storico è contenuto (6,73%), indicando una buona resilienza.

5. RISCHI, LIMITI E DISCLAIMER

- I risultati si basano su dati storici e non possono replicare perfettamente slippage, liquidità variabile o ritardi reali.
- Il capitale investito è a rischio. I rendimenti passati non garantiscono risultati futuri.
- **Target utente:** Investitori con orizzonte medio-lungo periodo che accettano la volatilità fisiologica 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)

