EA LAB · APPROFONDIMENTO DEL TEST 001

Gold Beaver v5.57 Ottimizzazione e prove di robustezza

DOCUMENTO PRIVATO IN ANTEPRIMA — NON PUBBLICATO. 23 novembre 2026 · Strategie MT5 su XAUUSD · 1.000 EUR di deposito, 0,01 lotti fissi.

Sintesi del lavoro

• **191 risultati di ottimizzazione** (95 broker, 96 tick), di cui 95 coppie di parametri confrontabili.

• **3 configurazioni selezionate:** Passo 015 / Mode 32 / Smoothing 6, Passo 060 / Mode 24 / Smoothing 4, Passo 095 / Mode 27 / Smoothing 3.

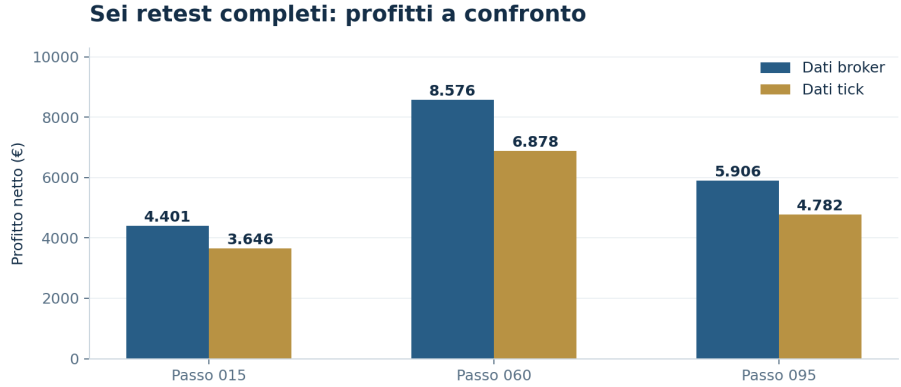
• **6 report MT5 completi:** due feed per ogni configurazione. Tutti positivi, ma con differente esposizione al rischio.

• **Segnale d'allarme:** Mode 33 dell'ottimizzazione +7.865 EUR broker ma -998,54 EUR tick: confronto dei feed essenziale.

• **Metodo di calcolo diverso:** le ottimizzazioni sono state eseguite a un minuto; i sei retest completi sono stati eseguiti a tick. È quindi normale osservare scarti, soprattutto sul Passo 015.

Il criterio di valutazione

Come confermato dal trader, le due ottimizzazioni sono state svolte con **modellazione a un minuto** per velocizzare lo screening; i sei HTML sono **backtest completi a tick** e costituiscono la base primaria del giudizio. Questo metodo veloce si utilizza soltanto quando controlli preliminari mostrano coerenza sufficiente fra M1 e tick. Se i risultati sono radicalmente diversi, anche l'ottimizzazione va eseguita a tick. Il grafico del Tester in timeframe M1 non indica, da solo, il tipo di modellazione. Nel drawdown distinguo massimi monetari e relativi.

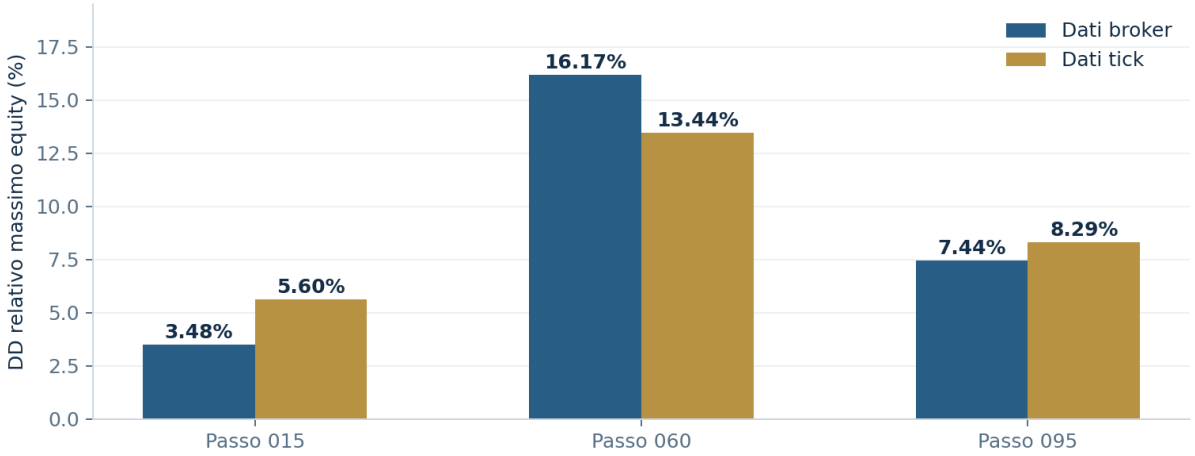


1 · Il confronto completo dei sei retest

Passo	Feed	Profitto EUR	PF	DD equity max	DD rel.	Recovery	Trade
015	broker	4.401,44	3,61	40.51 (2.53%)	3.48%	108,65	3191
015	tick	3.645,81	2,71	162.46 (5.60%)	5.60%	22,44	3205
060	broker	8.576,47	2,66	235.73 (16.17%)	16.17%	36,38	4067
060	tick	6.878,11	2,23	266.51 (5.05%)	13.44%	25,81	4095
095	broker	5.906,22	3,86	142.96 (2.83%)	7.44%	41,31	1934
095	tick	4.782,12	3,0	257.40 (6.29%)	8.29%	18,58	1936

Il Passo 060 tick è il caso più semplice per evitare errori di lettura: DD equity massimo **266,51 EUR (5,05%)** e massimo relativo **13,44% (182,15 EUR)** appartengono a due episodi distinti.

Il rischio: massimo drawdown relativo equity



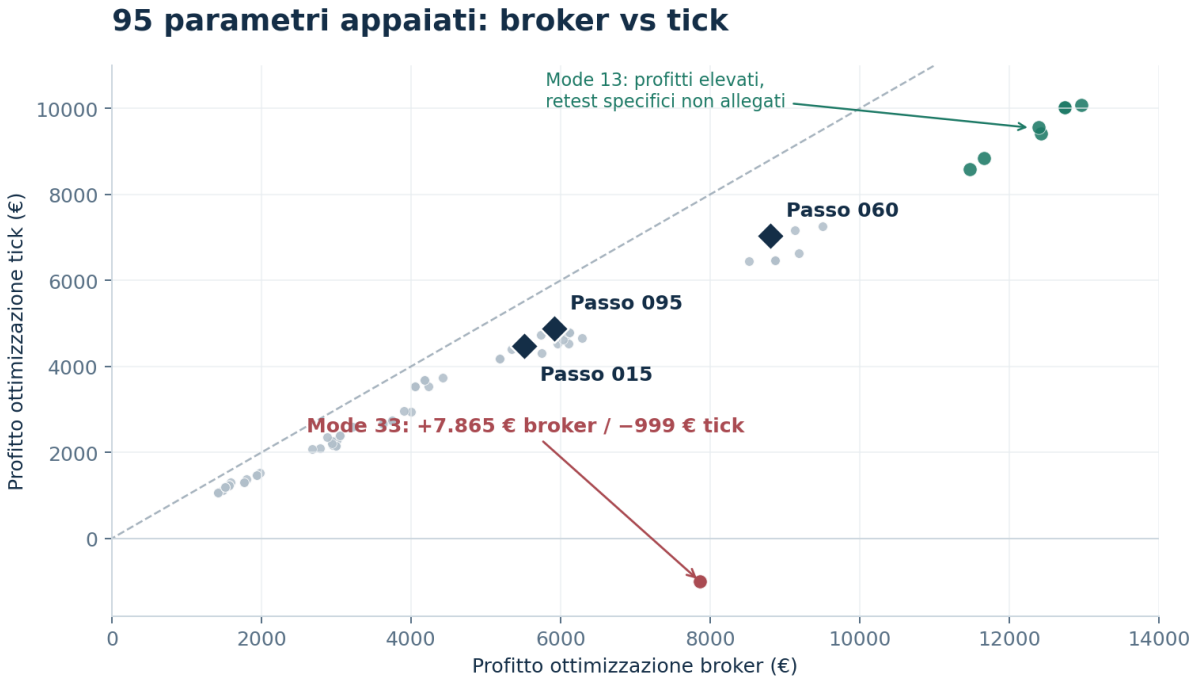
Profili operativi

• **015:** il più difensivo storicamente, ma payoff medio tick solo 1,14 EUR/trade, durata media 0:06:58 e forte dipendenza dal 2026.

• **060:** profitto massimo, drawdown relativo a due cifre e posizioni fino a circa 475 ore.

• **095:** utile tick +4.782,12 EUR, DD relativo 8,29%, payoff medio 2,47 EUR/trade; win rate elevato a fronte di perdite medie superiori alle vincite medie.

2 · Che cosa raccontano i 95 risultati appaiati



Mode 33 e Mode 13

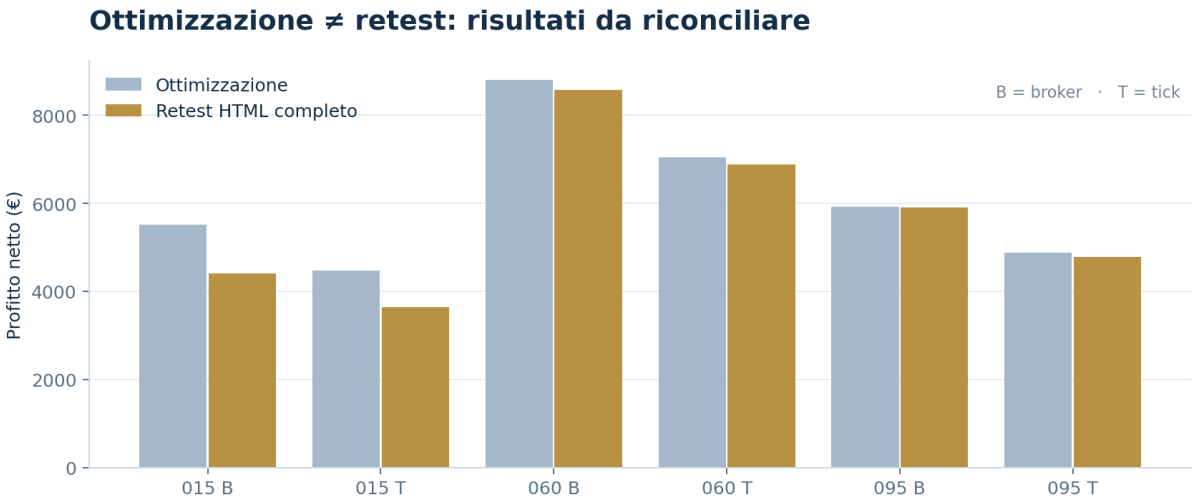
Mode 33: cinque combinazioni appaiate producono circa +7.865 EUR nello screening M1 broker, contro -998,54 EUR nello screening M1 su storico Tickstory. Il drawdown del secondo arriva a circa 99,9%. Questi risultati non equivalgono a un retest tick-by-tick della Mode 33, che non è allegato.

Mode 13: è tra le modalità con i maggiori profitti nei due Excel: fino a +12.968,01 EUR broker e +10.083,45 EUR tick. Non sono però disponibili retest completi dedicati, quindi non entra nella graduatoria finale dei tre candidati.

Sensibilità InpSmoothing

Mode 32 fornisce, negli Excel, risultati uguali per tutti i valori di smoothing osservati. Questa insensibilità potrebbe dipendere dalla logica interna dell'EA e **non dimostra di per sé robustezza**. Occorrono sorgente o prove dedicate.

3 · Ottimizzazione M1 contro retest a tick

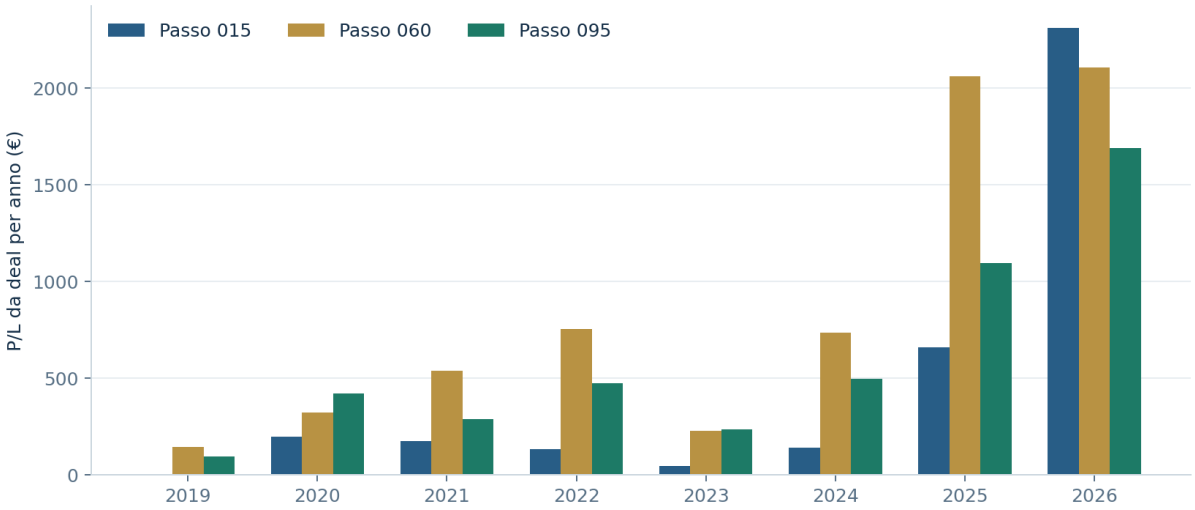


Passo	Feed	Ottimizz. EUR	Retest EUR	Differenza EUR	Trade opt → full
015	broker	5.512,00	4.401,44	-1.110,56 (-20,15%)	3.191 → 3.191
015	tick	4.471,65	3.645,81	-825,84 (-18,47%)	3.205 → 3.205
060	broker	8.805,11	8.576,47	-228,64 (-2,60%)	4.070 → 4.067
060	tick	7.045,45	6.878,11	-167,34 (-2,38%)	4.090 → 4.095
095	broker	5.916,49	5.906,22	-10,27 (-0,17%)	1.939 → 1.934
095	tick	4.876,94	4.782,12	-94,82 (-1,94%)	1.934 → 1.936

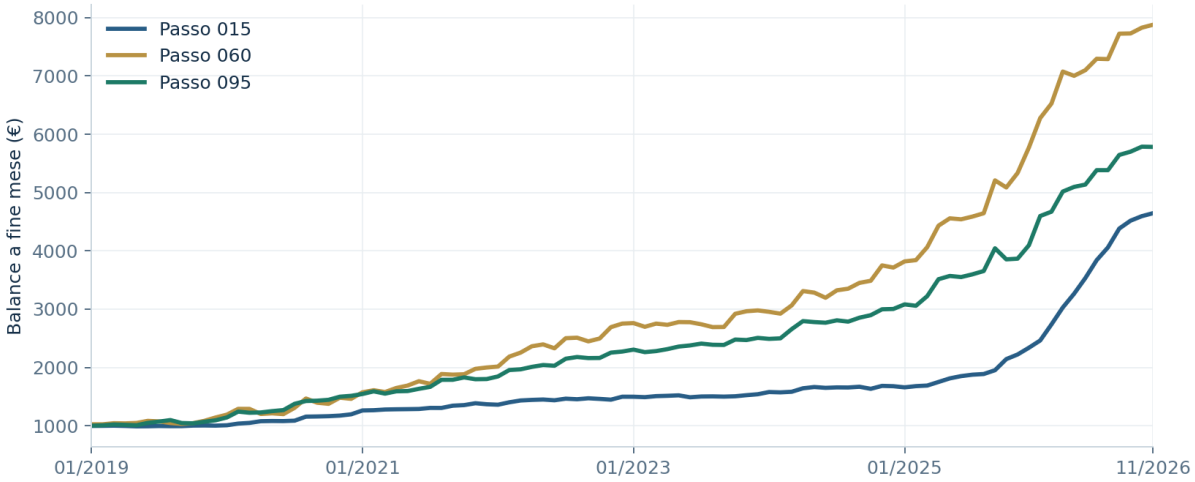
La differenza metodologica è confermata: **screening a un minuto contro verifica a tick**. Gli scarti non attestano quindi un errore di replica con modello identico. La loro ampiezza, in particolare sul 015, descrive la sensibilità del profitto al modello di simulazione; la quota imputabile al modello non è calcolabile senza conoscere tutte le altre condizioni di test. La Mode 33 negativa sul feed tick riguarda il solo screening M1 e richiederebbe un backtest tick separato.

4 · Distribuzione temporale dei profitti

Distribuzione annuale | dati tick



Curve balance ricostruite dai deal | dati tick



Il 2026 è un anno parziale. La quota del profitto tick realizzata nel 2025–2026 è 81,4% sul 015, 60,6% sul 060 e 58,1% sul 095. Le curve sono balance a fine mese ricostruite dai deal, **non equity intrabar**; non mostrano tutte le perdite flottanti.

5 · Stress dei costi e prossimi controlli

Stress ipotetico sui risultati tick

Costo aggiuntivo / trade	Passo 015	Passo 060	Passo 095
0 EUR	3.645,81 EUR	6.878,11 EUR	4.782,12 EUR
0,25 EUR	2.844,56 EUR	5.854,36 EUR	4.298,12 EUR
0,50 EUR	2.043,31 EUR	4.830,61 EUR	3.814,12 EUR
1,00 EUR	440,81 EUR	2.783,11 EUR	2.846,12 EUR

Esercizio puramente aritmetico: aggiungo un costo fisso ulteriore per trade ai costi già contabilizzati. Non è una simulazione di fill/slippage, né un nuovo backtest. Le soglie medie di azzeramento dell'utile sono circa 1,14 EUR/trade (015), 1,68 EUR/trade (060) e 2,47 EUR/trade (095).

Sequenza di ricerca consigliata

• **1.** Verificare con alcuni parametri fissi l'allineamento fra modelli M1 e tick; impiegare M1 solo per lo screening quando tale allineamento è sufficiente, altrimenti ottimizzare direttamente sui tick.

• **2.** Ripetere il preset originale del Test 001 su identico periodo e feed (il Test 001 si fermava a ottobre 2026).

• **3.** Stressare spread, slippage, swap, costi, lotti, parametri adiacenti e durata delle posizioni.

• **4.** Verificare Mode 13, che appare interessante nell'ottimizzatore ma non è validato dai retest allegati.

• **5.** Progettare test walk-forward e raccogliere forward demo con preset congelati. Anni già usati per selezionare i parametri non diventano out-of-sample se separati dopo.

Conclusione operativa

Per un secondo ciclo approfondirei per primo il Passo 095 come compromesso: utile maggiore del 015, miglior margine per trade e rischio intermedio. Il Passo 015 resta un riferimento più conservativo, il 060 è la variante più aggressiva. **Nessuno dei tre è ancora validato per un impiego live sulla base di questi soli documenti.**

Fonti, inventario e limiti

2 Excel originali (95 + 96 righe), 6 HTML originali, grafici autonomi dai deal. Mancano le **24 PNG native MT5** richiamate dai report HTML; le metriche e la cronologia operativa contenute negli HTML restano leggibili. Questo documento è parte del pacchetto privato in anteprima. Nessuna pagina o articolo è stata pubblicata.

Rischio: i backtest non garantiscono risultati futuri; le ottimizzazioni sullo stesso campione possono produrre overfitting.