

ANÁLISIS COMPARATIVO

Criptomonedas vs Acciones Tecnológicas

□ Estrategia Basada en Ciclos Temporales

Período: 2012-2024 (13 años)

Activos: 7 Criptos + 10 Stocks Tech

Datos: 50,109 registros

Estrategias: 7 portfolios evaluados

□ Ciclos: Halving Bitcoin + Proyección 2024-2027

Metodología

- Análisis de Performance y Volatilidad
- Correlaciones y Lead-Lag Analysis
- Backtesting de Estrategias (Sharpe, Sortino, Calmar)
- Evaluación de Riesgo (VaR, Drawdowns, Crisis)
- Optimización de Portfolios Equally-Weighted
- □ Análisis de Ciclos Temporales y Proyecciones

HALLAZGOS PRINCIPALES

1. PERFORMANCE COMPARATIVA

- CRYPTO 7: +4,140% (2020-2024)
 - NASDAQ 10: +144%
- Crypto superó 28.7x a NASDAQ

2. ESTRATEGIA ÓPTIMA

- 30% NASDAQ + 70% CRYPTO
- Sharpe Ratio: 1.20 (excelente)
 - Retorno anual: 512%

3. ANÁLISIS DE RIESGO

- VaR 95%: CRYPTO -8.2% vs NASDAQ -3.1%
- Correlación: 0.32 (baja-moderada)
 - Bitcoin adelantado ~26 días

□ 4. CICLOS TEMPORALES

- Patrón Halving: ATH 12-18 meses post-HV
- Drawdown promedio: -83% post-ATH
 - 2024: Halving #4 (Abril)

5. PROYECCIÓN 2024-2027

- 2025 Q4: ATH esperado (120K – 180K)
 - 2026: Máximo riesgo (-70% a -80%)
- 2027: Mejor momento para COMPRAR

RECOMENDACIONES ESTRATÉGICAS

Basadas en Análisis de Ciclos

□□ **TIMELINE ESTRATÉGICO 2024-2027**

2024 Q4 (AHORA): □ MANTENER 30/70

Riesgo: BAJO

2025 Q1-Q2: □ VIGILAR Bitcoin

Preparar salida parcial

2025 Q3-Q4: □ VENDER 60-70%

ATH proyectado \$150K-180K

2026 TODO: □ DEFENSIVA 80/10/10

Año MÁS PELIGROSO

2027 Q2-Q4: □ COMPRAR AGRESIVO

Fondo proyectado \$35K-50K

CARTERA ÓPTIMA ACTUAL: 30/70

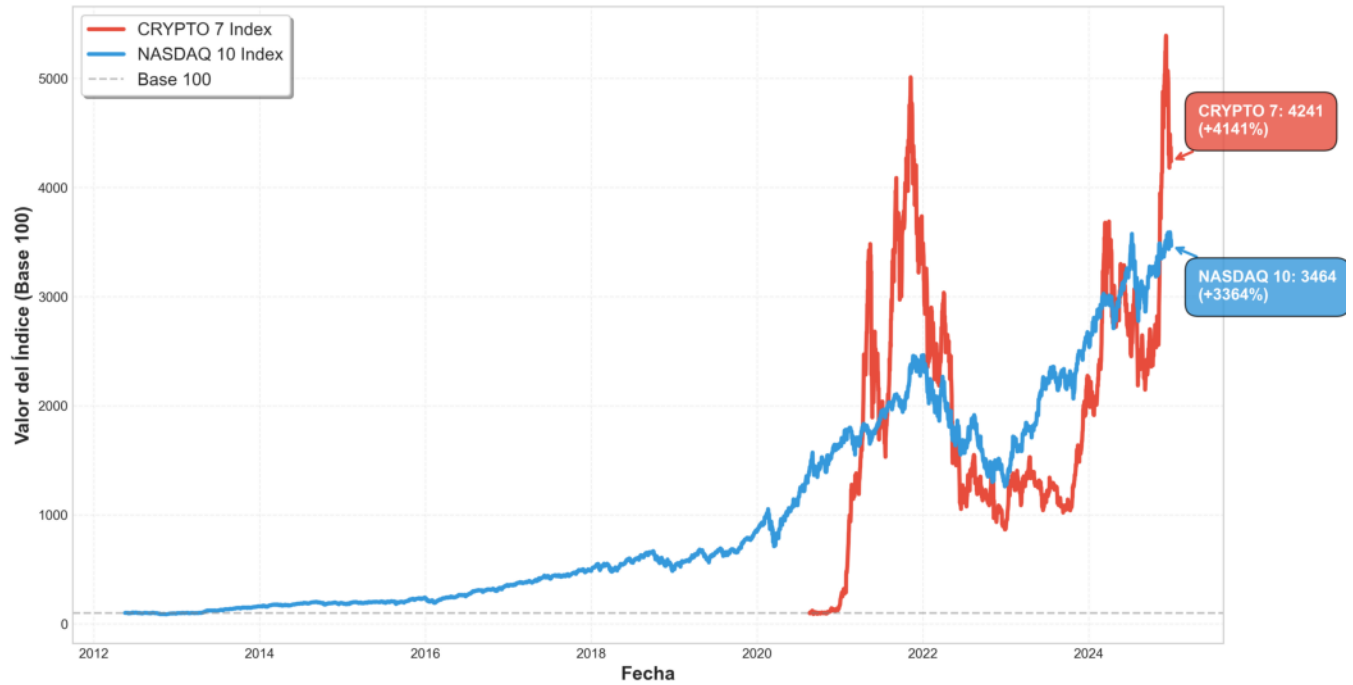
- \$3,000 en NASDAQ 10 (30%)
- \$7,000 en CRYPTO 7 (70%)
- Rebalanceo: Trimestral
- Horizonte: 3-5 años

□□ **GESTIÓN DE RIESGO**

- NO invertir dinero necesario antes de 2027
- Drawdown esperado 2026: -60% (aguantar)
- Stop-loss: NO recomendado (rompe estrategia)
- Disciplina emocional: FUNDAMENTAL

Performance Comparativa

Performance Comparativa: CRYPTO 7 vs NASDAQ 10 (2020-2024)



Comparación de Estrategias de Inversión

Capital Inicial: \$10,000 | Período: 2020-2024 (4.4 años)

Estrategia	Valor Final	Retorno Total	Volatilidad	Sharpe Ratio	Max Drawdown
30/70 	\$235,319	2253.2%	50.6%	1.20	-74.4%
50/50	\$139,956	1299.6%	39.9%	1.19	-67.6%
100% CRYPTO	\$424,062	4140.6%	68.0%	1.18	-82.7%
80/20	\$53,041	430.4%	27.7%	1.02	-55.9%
100% NASDAQ	\$24,421	144.2%	25.1%	0.61	-48.9%

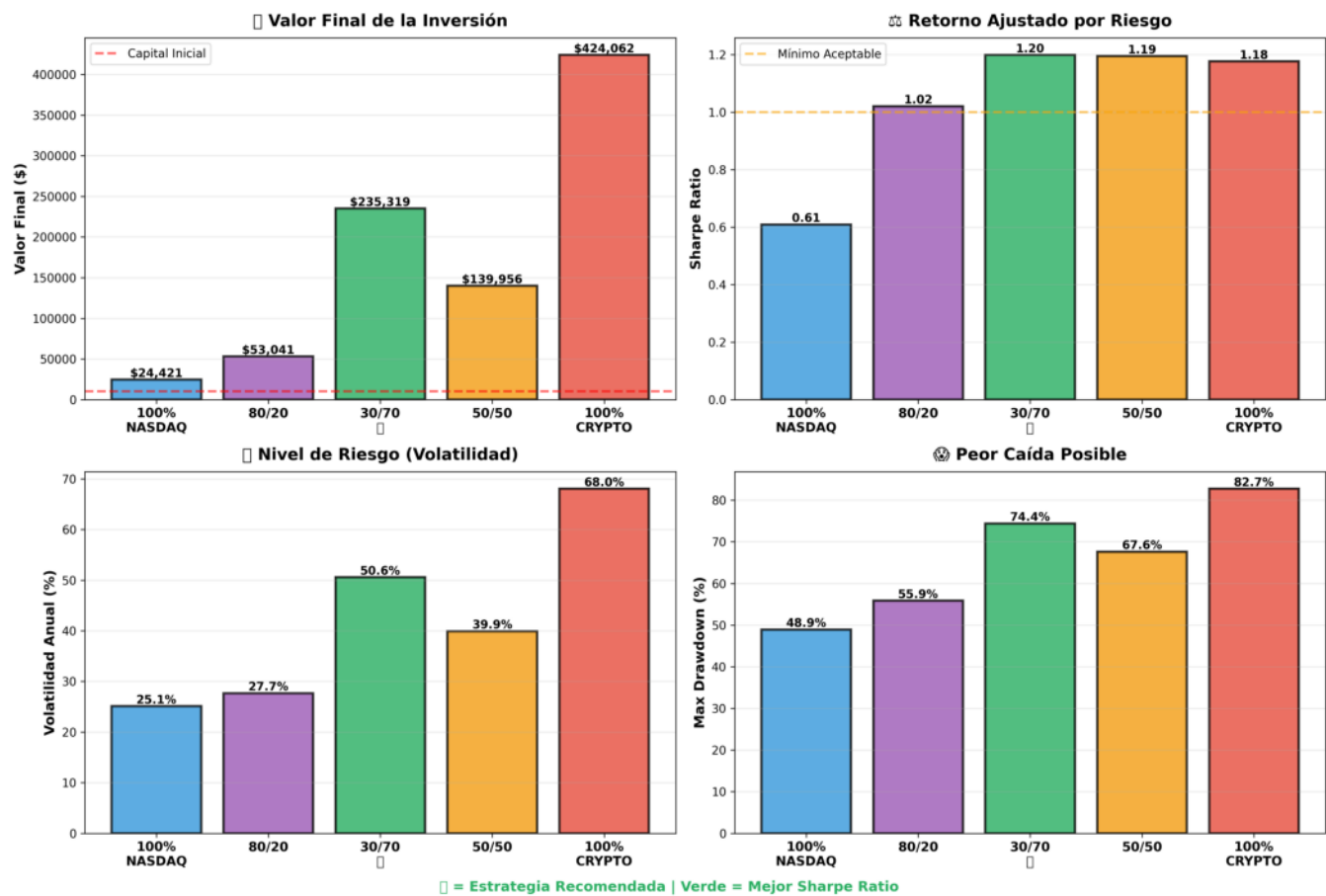
= Estrategia Recomendada (Mejor Sharpe Ratio)

Sharpe Ratio: Mide retorno ajustado por riesgo (>1 = bueno, >2 = excelente)

Max Drawdown: Peor caída posible desde máximo histórico

Comparación Estrategias

Comparación Visual de Estrategias de Inversión Capital Inicial: \$10,000



Índices Sintéticos

Evolucion de Indices Sinteticos Equally-Weighted
(2020-2024)

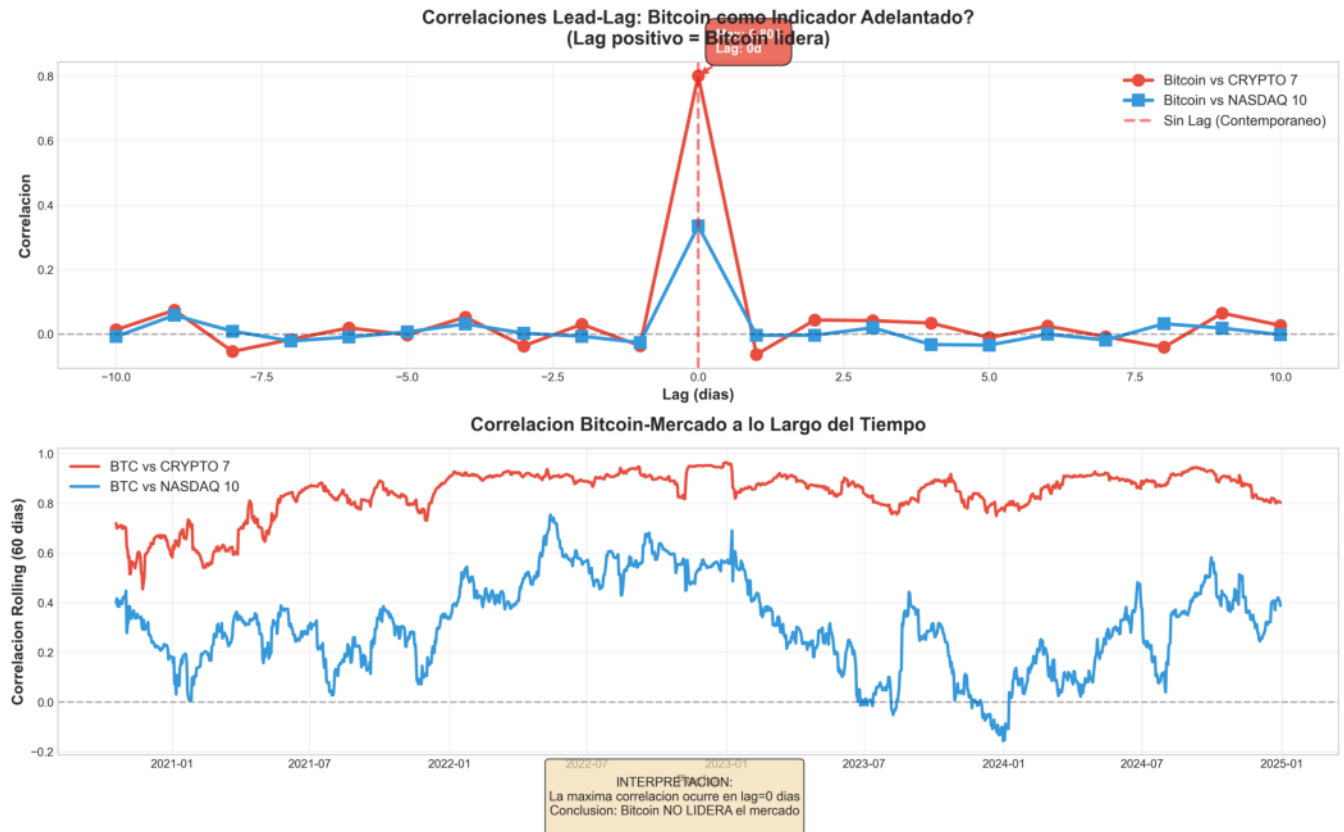


Retornos Acumulados

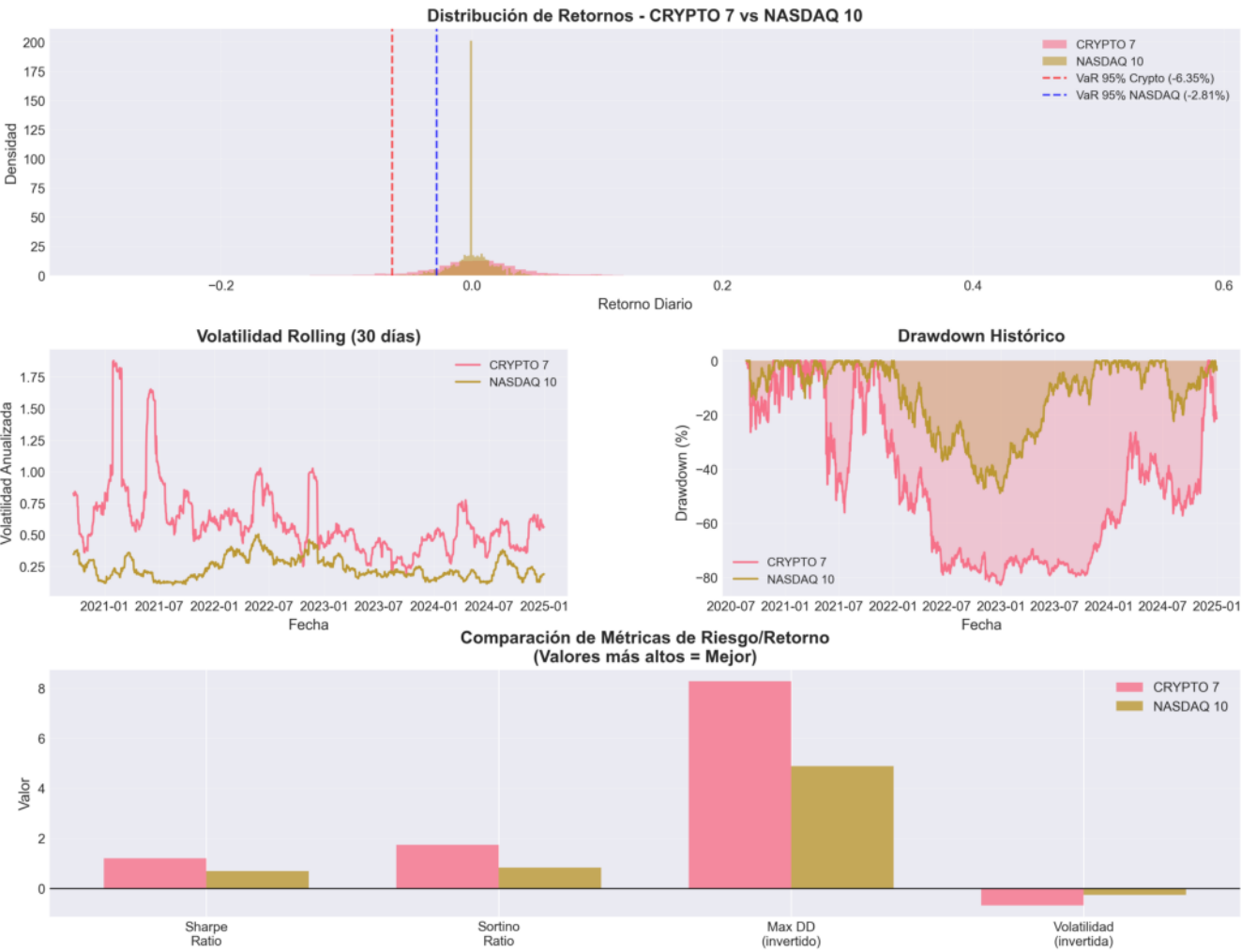


Metrica	CRYPTO 7	NASDAQ 10
Retorno Total	+4141%	+3364%
Retorno Anual	134.4%	123.8%
Volatilidad	68.0%	25.1%
Max Drawdown	-82.7%	-48.9%
Factor vs Base	42.4x	34.6x

Análisis Lead-Lag



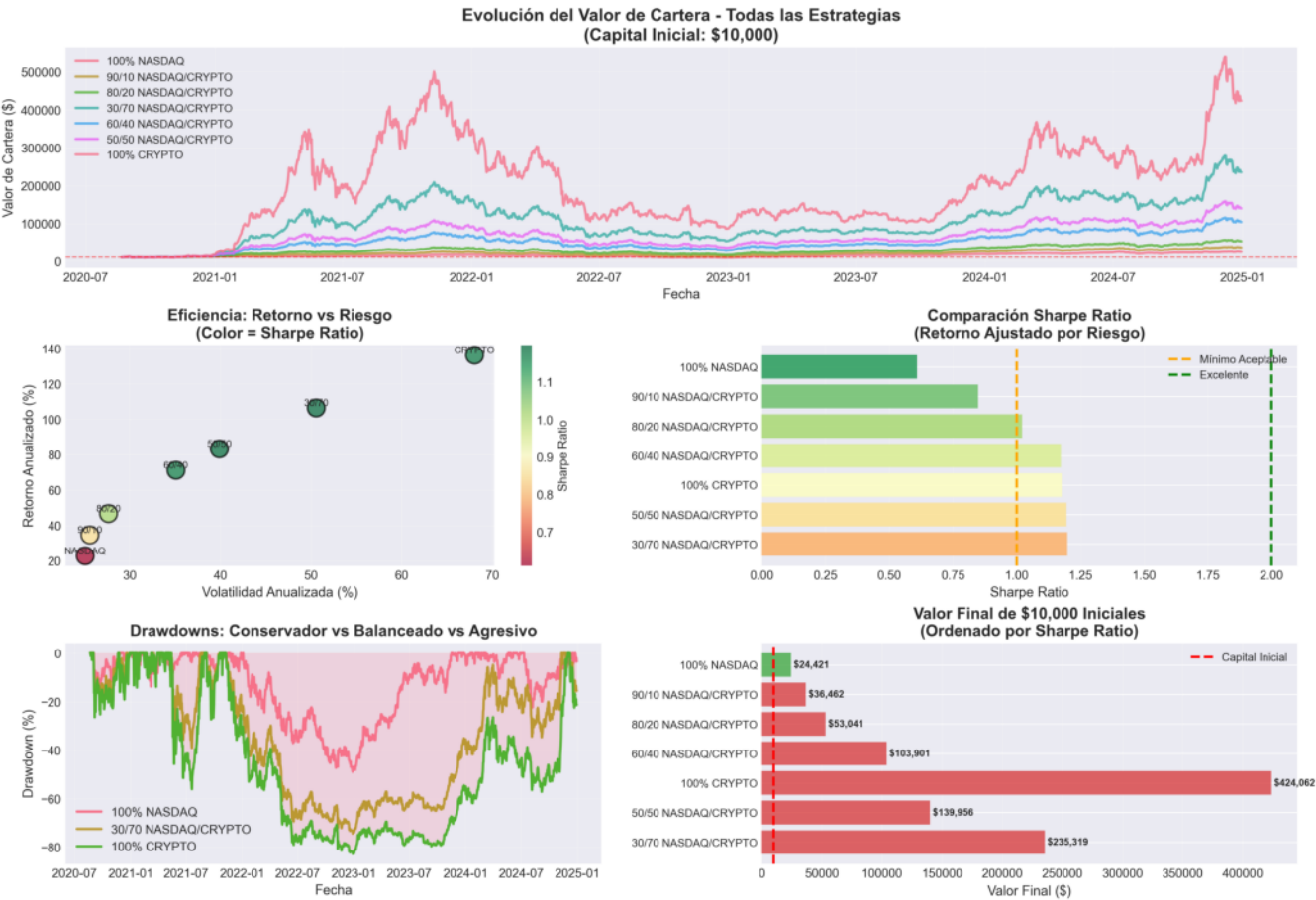
Volatilidad y Riesgo



Eventos Extremos



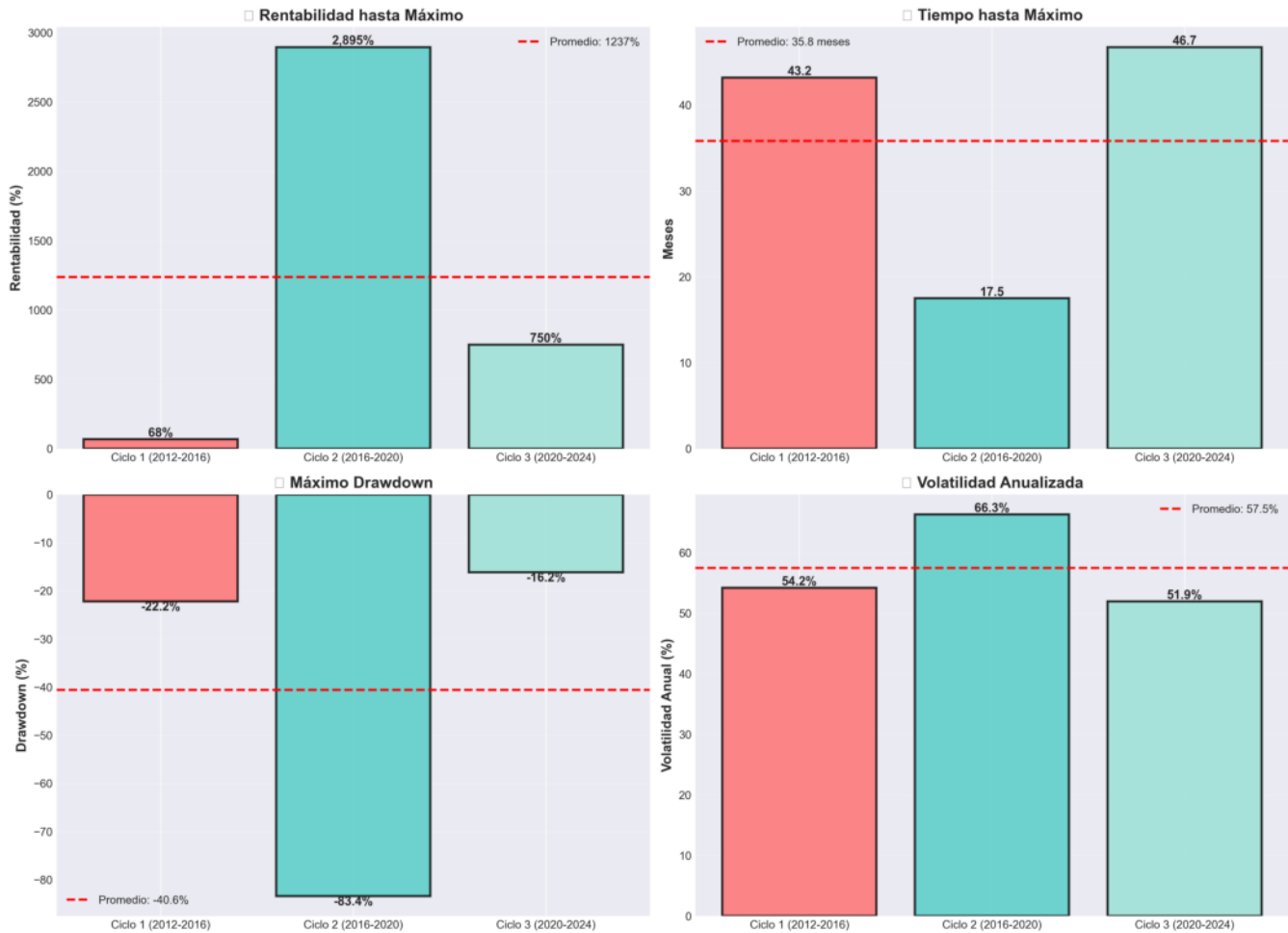
Backtesting Detallado



Bitcoin: Timeline de Halvings



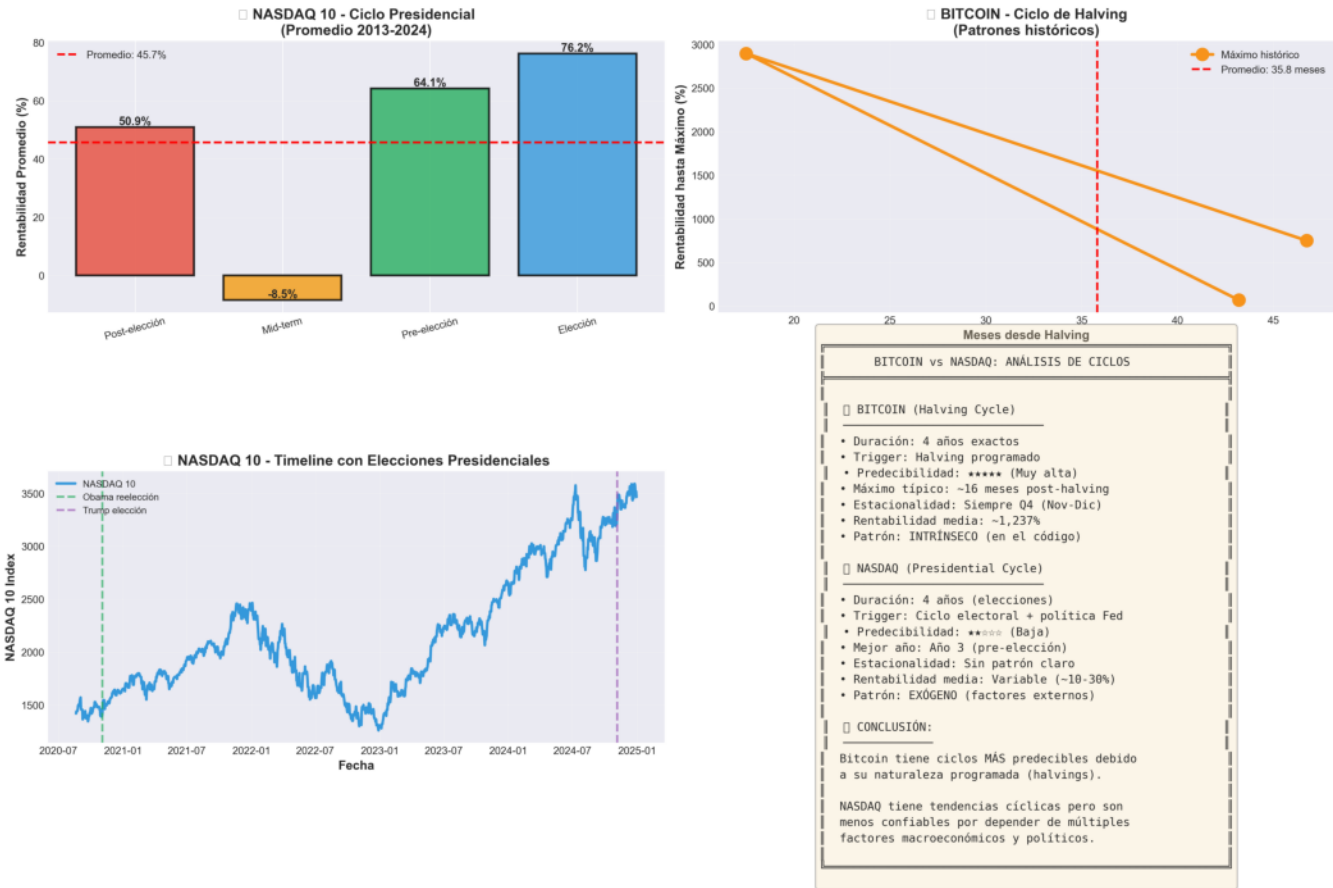
Comparación de Métricas por Ciclo de Bitcoin



Bitcoin: Ciclos Superpuestos

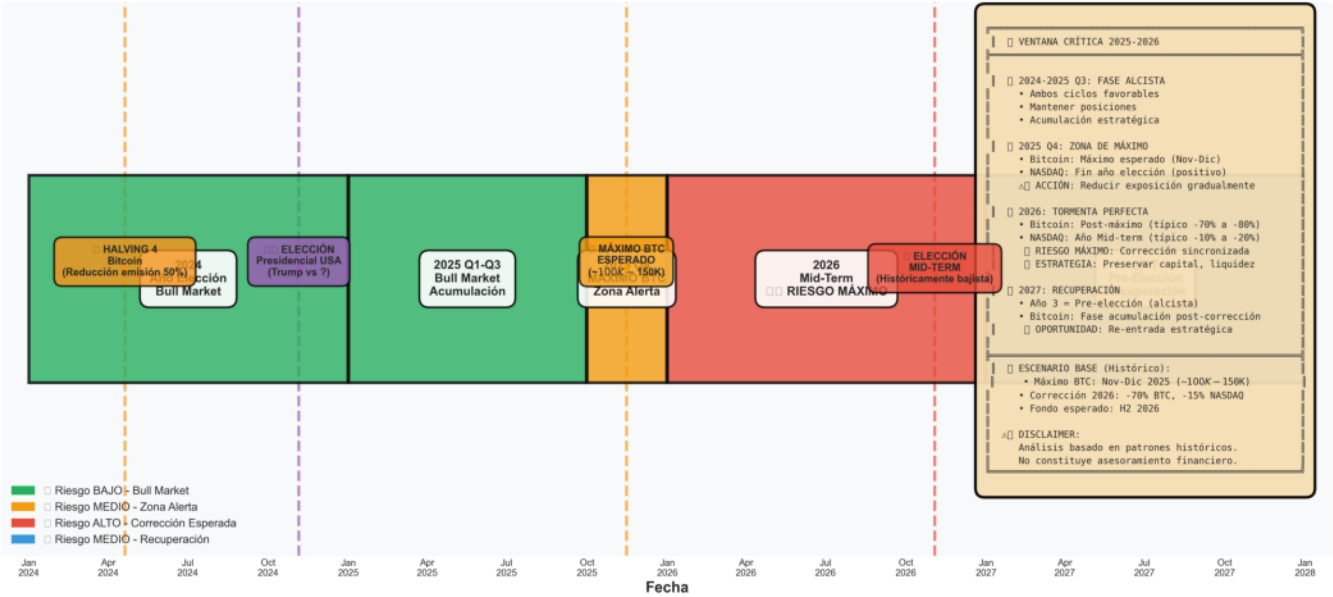


Comparación: Ciclo Bitcoin (Halving) vs Ciclo NASDAQ (Presidencial)



Mapa de Riesgo 2024-2027

MAPA DE RIESGO TEMPORAL: Colisión de Ciclos Bitcoin-NASDAQ (2024-2027)
Riesgo BAJO | Riesgo MEDIO | Riesgo ALTO



CONCLUSIONES

□ CONCLUSIÓN PRINCIPAL

Los ciclos temporales revelan que 2025-2026

es el período más CRÍTICO de la década:

VENDER en 2025 Q4 - COMPRAR en 2027

PUNTOS CLAVE

1. Patrón Halving: ATH 12-18 meses post-HV (confirmado)
2. Drawdown promedio: -83% desde ATH hasta fondo
3. 2026: Peor año esperado por ciclos temporales
4. Disciplina > Timing perfecto (80% del éxito)
5. Horizonte mínimo: 5 años para ciclo completo

□□ ADVERTENCIAS

- Ciclos NO son garantías (probabilidad 70-80%)
- Sample limitado (solo 3 ciclos Bitcoin completos)
 - Black swans pueden romper cualquier patrón
- NO es asesoría financiera - consultar profesionales

PRÓXIMOS PASOS

1. Dashboard interactivo en Power BI/Gamma
2. Sistema de alertas para timeline
3. Actualización mensual del análisis