

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)

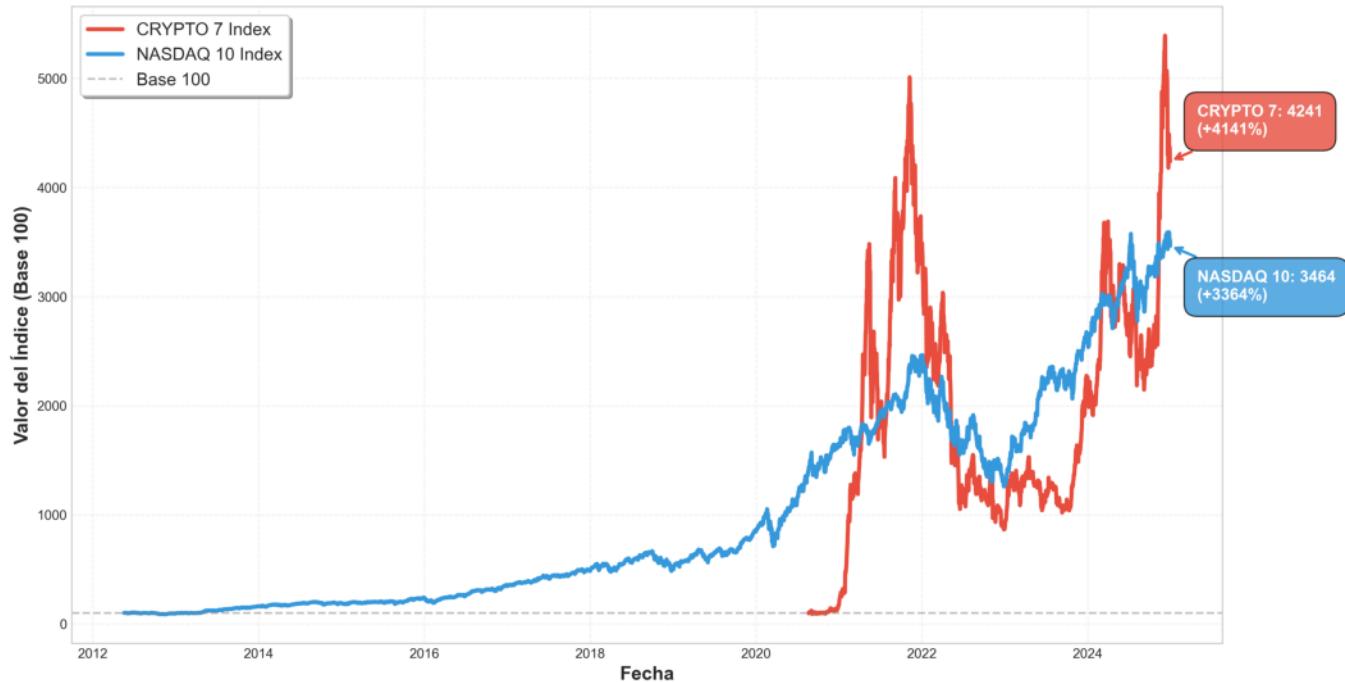


Tabla Backtesting

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% |

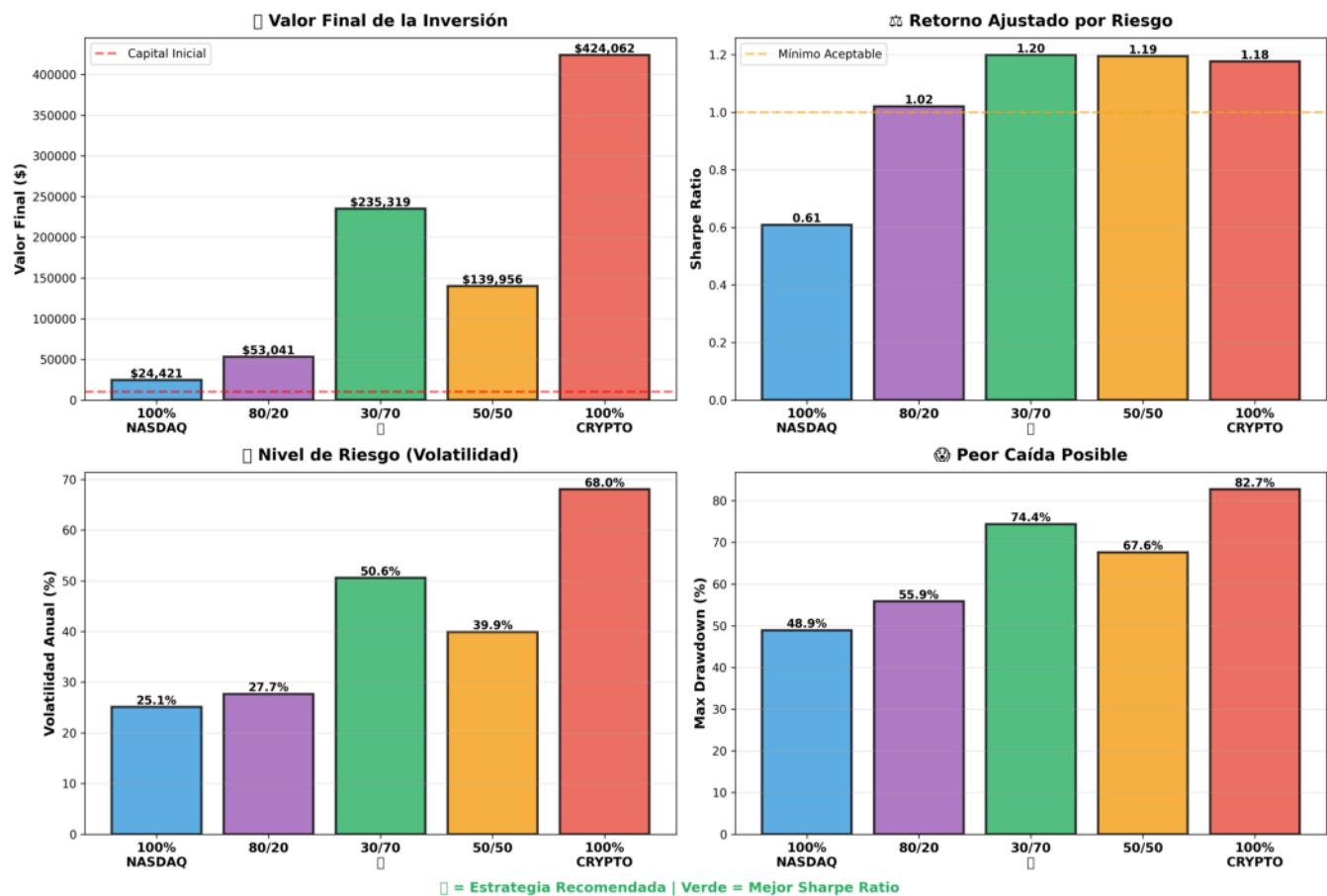
☐ = Estrategia Recomendada (Mejor Sharpe Ratio)

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

☐ Max Drawdown: Peor caída posible desde máximo histórico

Comparación Estrategias

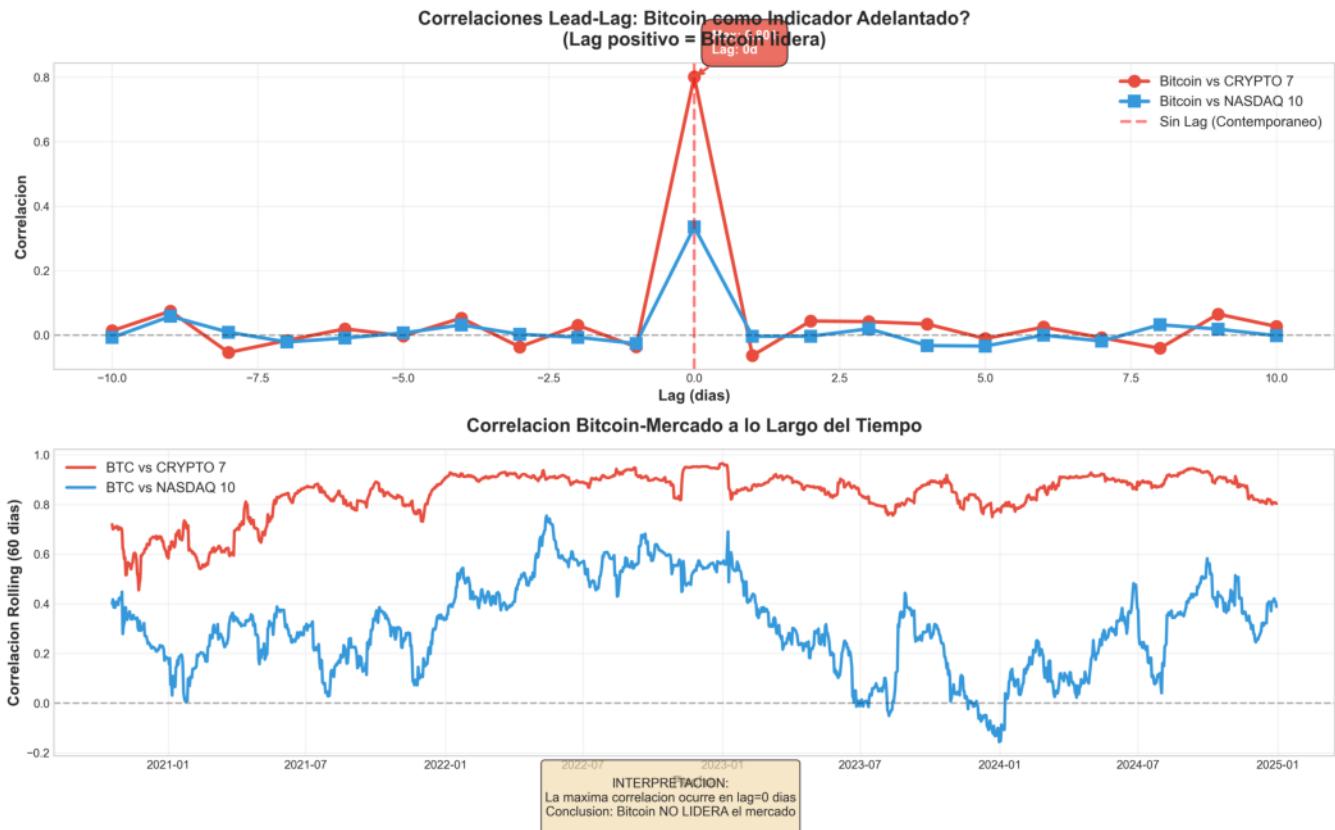
Comparación Visual de Estrategias de Inversión Capital Inicial: \$10,000



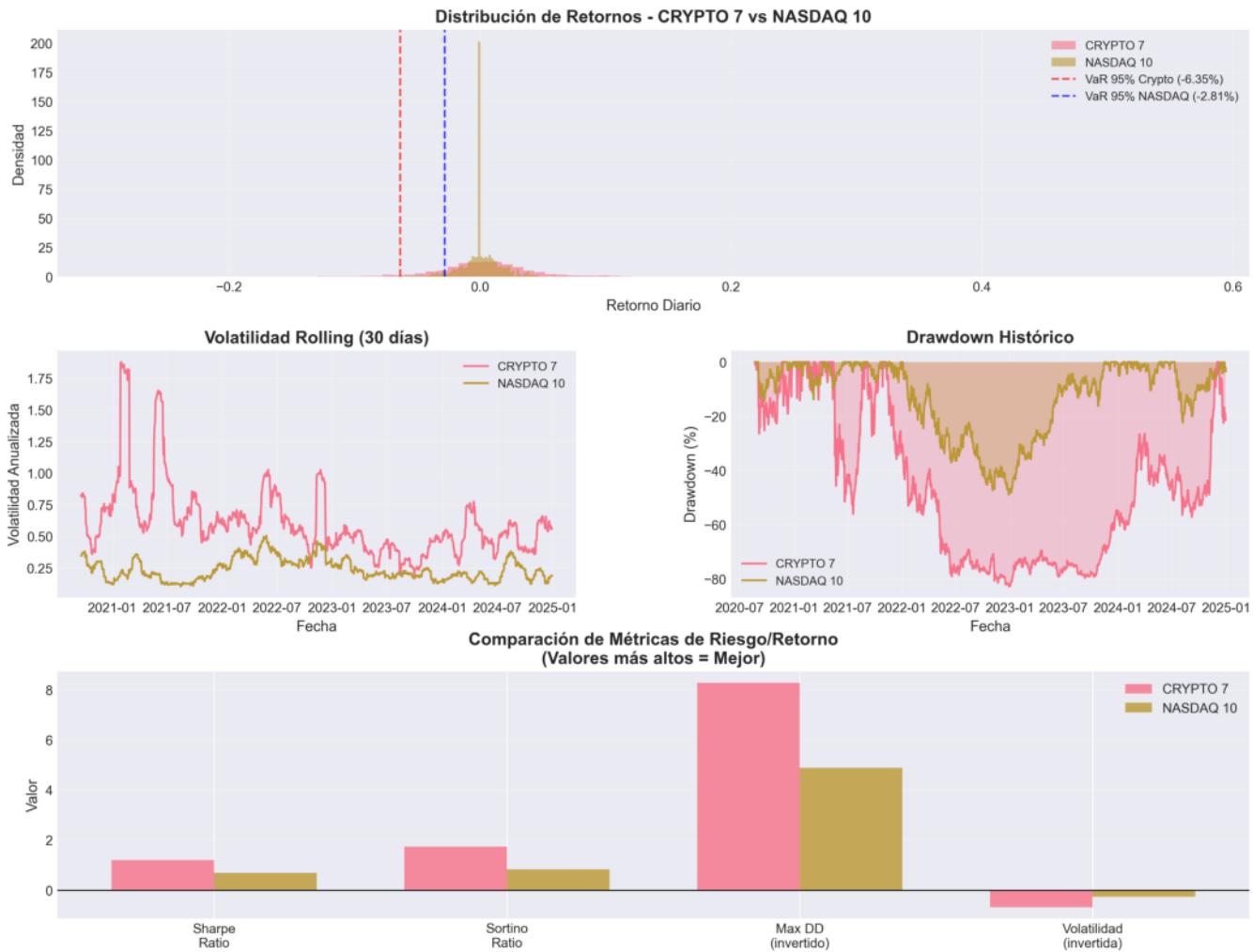
Índices Sintéticos



Análisis Lead-Lag



Volatilidad y Riesgo



Eventos Extremos



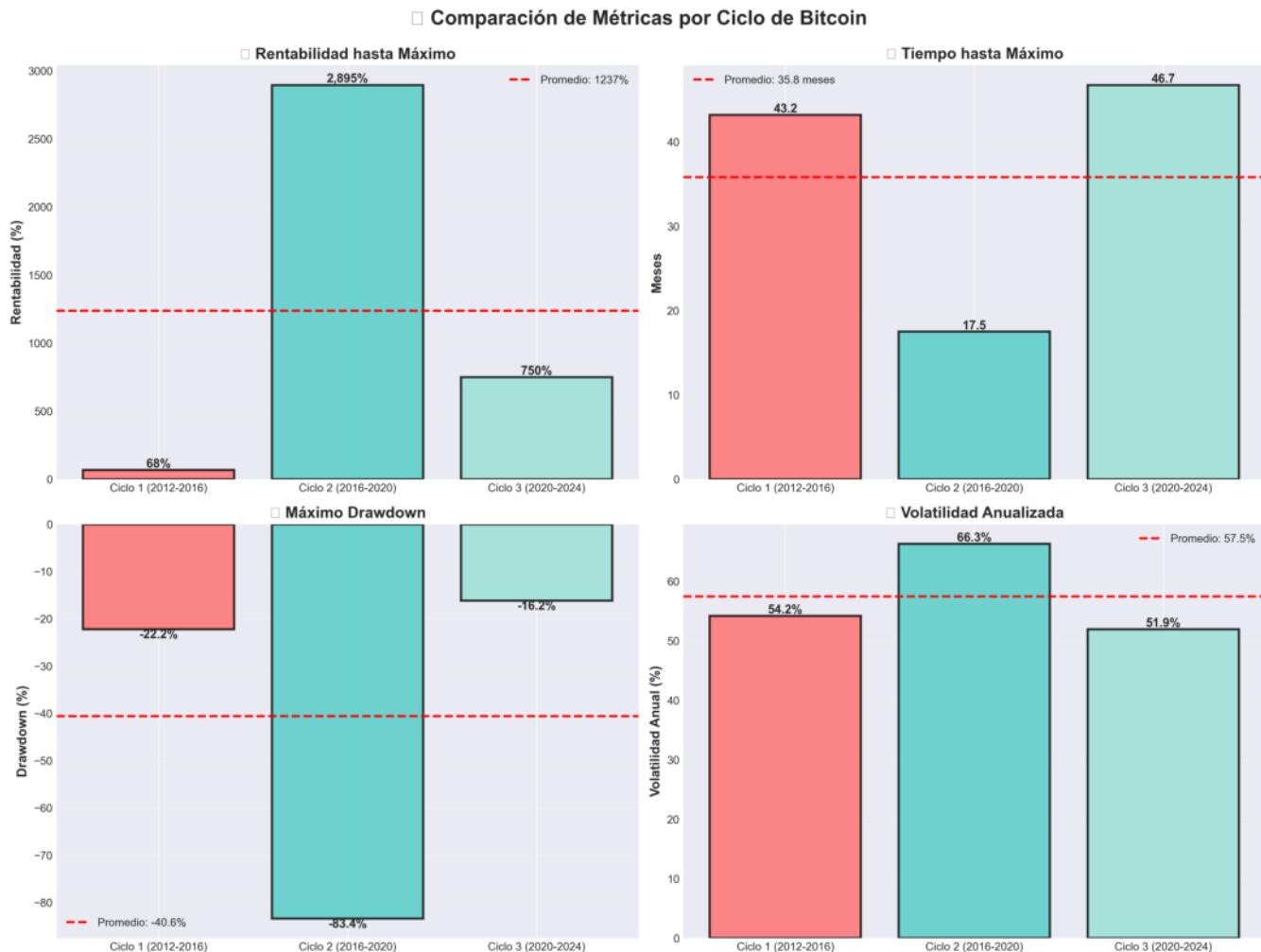
Backtesting Detallado



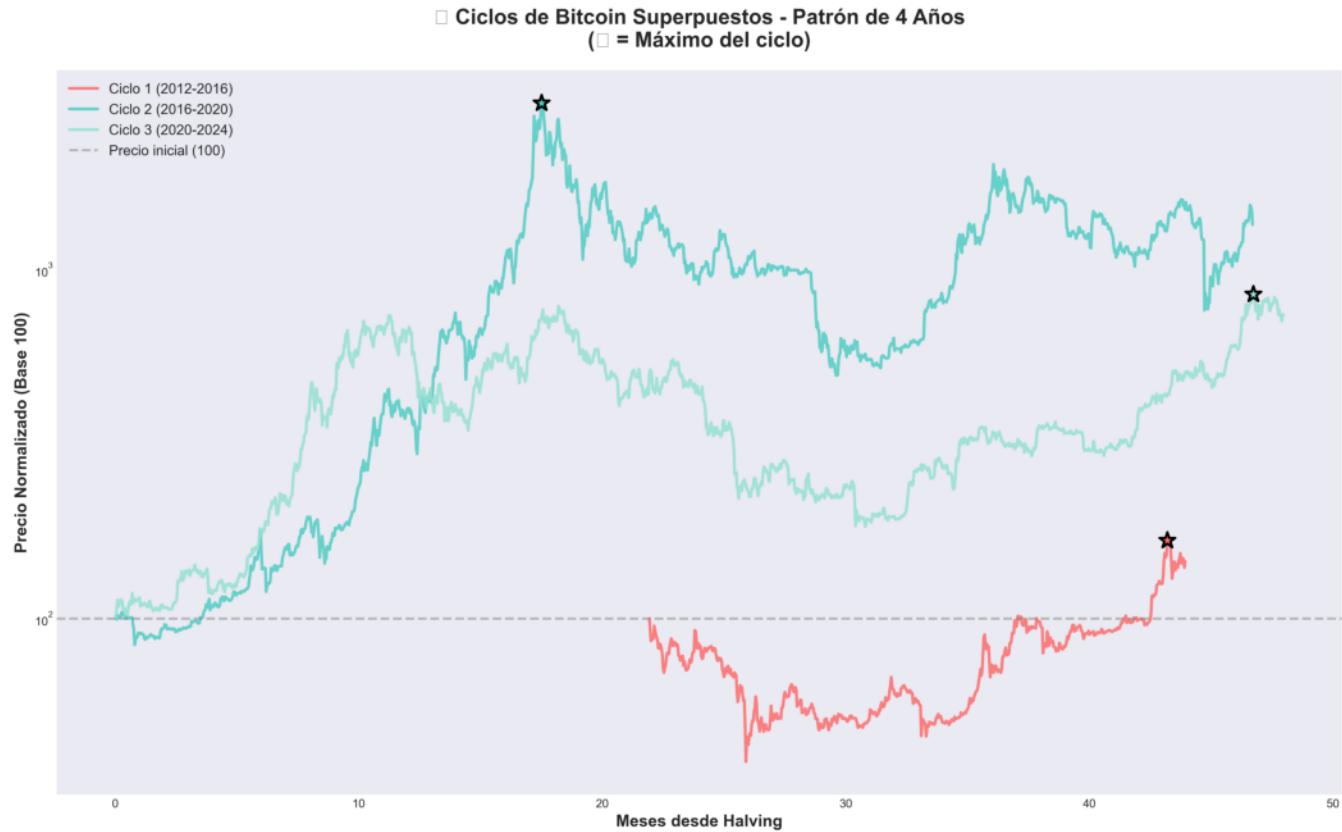
Bitcoin: Timeline de Halvings



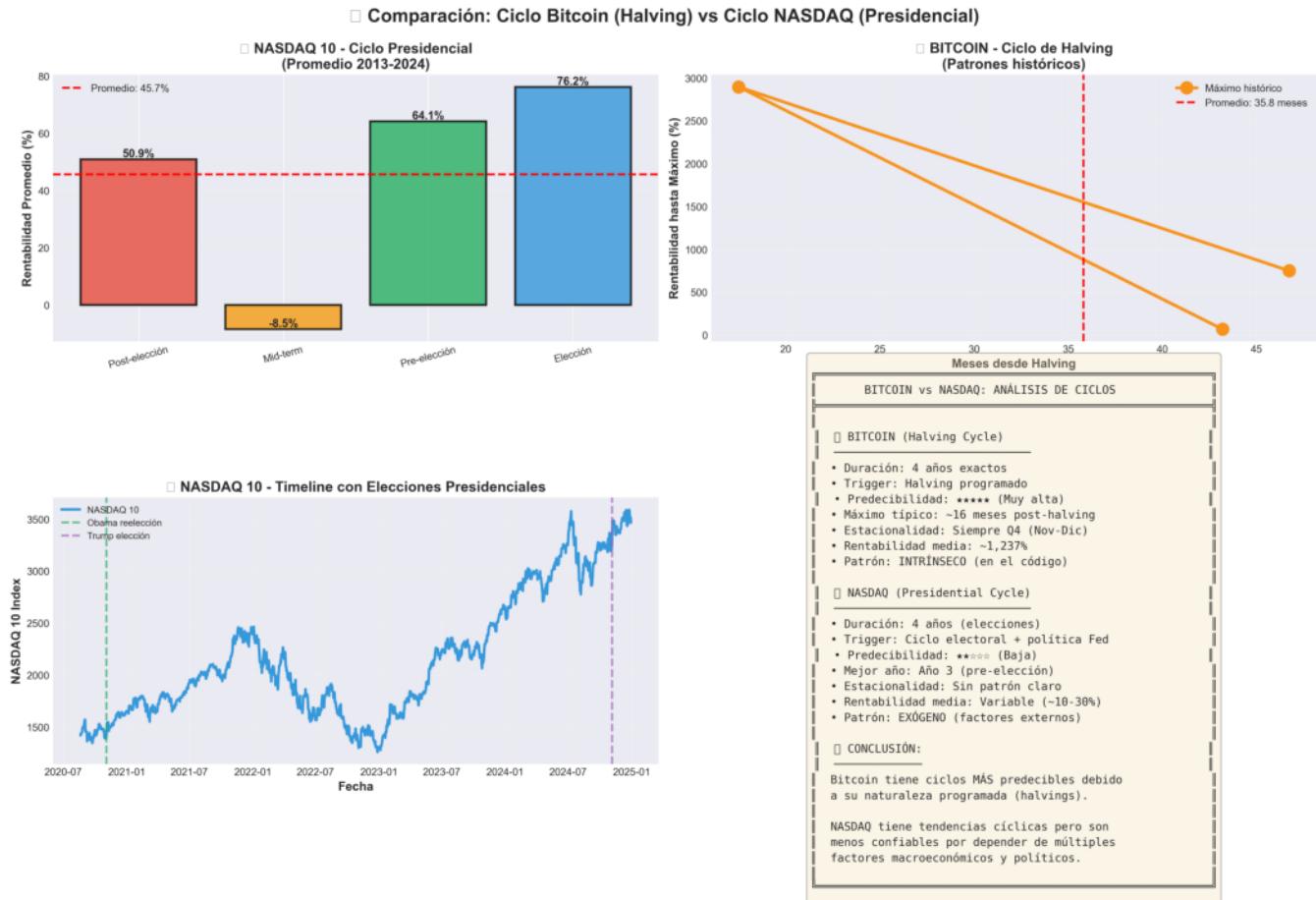
Bitcoin: Métricas por Ciclo



□ Bitcoin: Ciclos Superpuestos

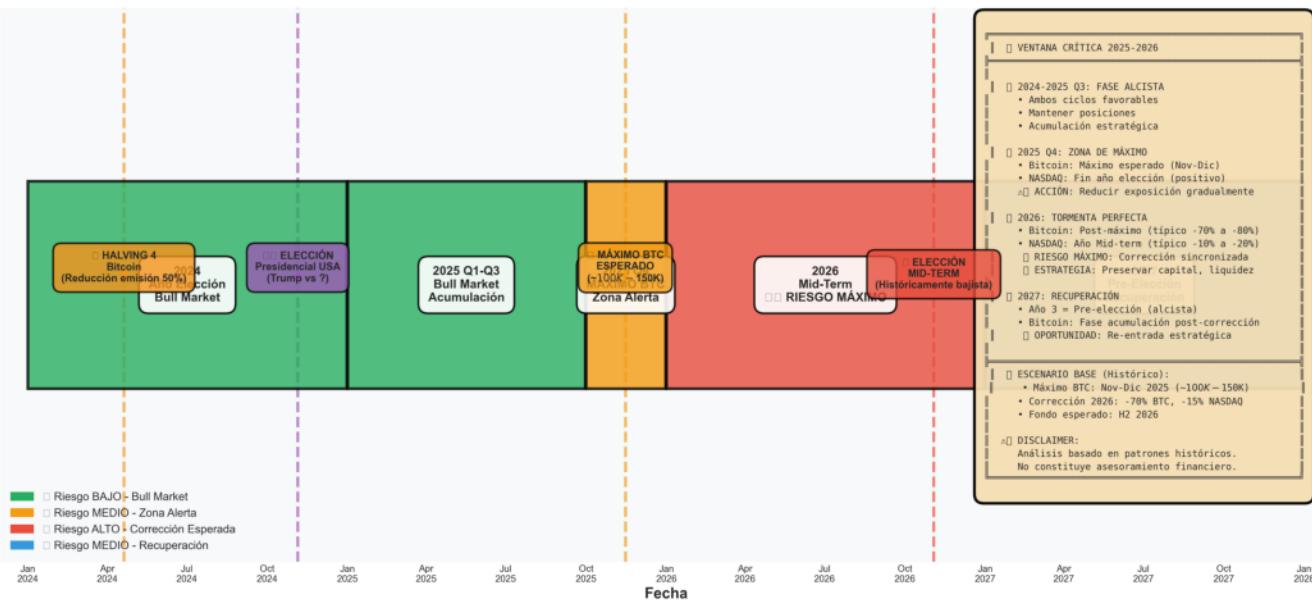


Bitcoin vs NASDAQ: Ciclos



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