



Backtest 1 año — 1 BTC de saldo inicial

Simulación 19 sep 2025 → 19 sep 2026 · 8.902 velas 1h · maker 0,05 % · margen ATR 0,35–0,9 % · sin compound · sin withdraw. Misma lógica que el Bot IA vivo.

+101 %

ROI en BTC (MTM)

2,010 BTC

Equity final

163.805 \$

Valor USD hoy

25,0 %

Max drawdown

RESUMEN — PARTISTE CON 1 BTC HACE 1 AÑO

BTC/USD: 115.632 \$ (19-sep-2025) → 81.503 \$ (19-sep-2026). BTC bajó -29,5 %. Apertura = 115.632 \$.

QUÉ PASÓ CON ESE 1 BTC	SALDO BTC	VALOR USD	VS APERTURA
Apertura · 19 sep 2025	1,000 BTC	115.632 \$	—
Tras 1 año con el Bot IA (MTM)	2,010 BTC	163.805 \$	+48.173 \$ · +41,7 %
Si hubieras guardado el 1 BTC sin operar	1,000 BTC	81.503 \$	-34.129 \$ · -29,5 %
Buy&hold del ratio XMR/BTC	≈2,716 BTC	221.336 \$	+105.704 \$ · +91,4 %

1 → 2,010 BTC

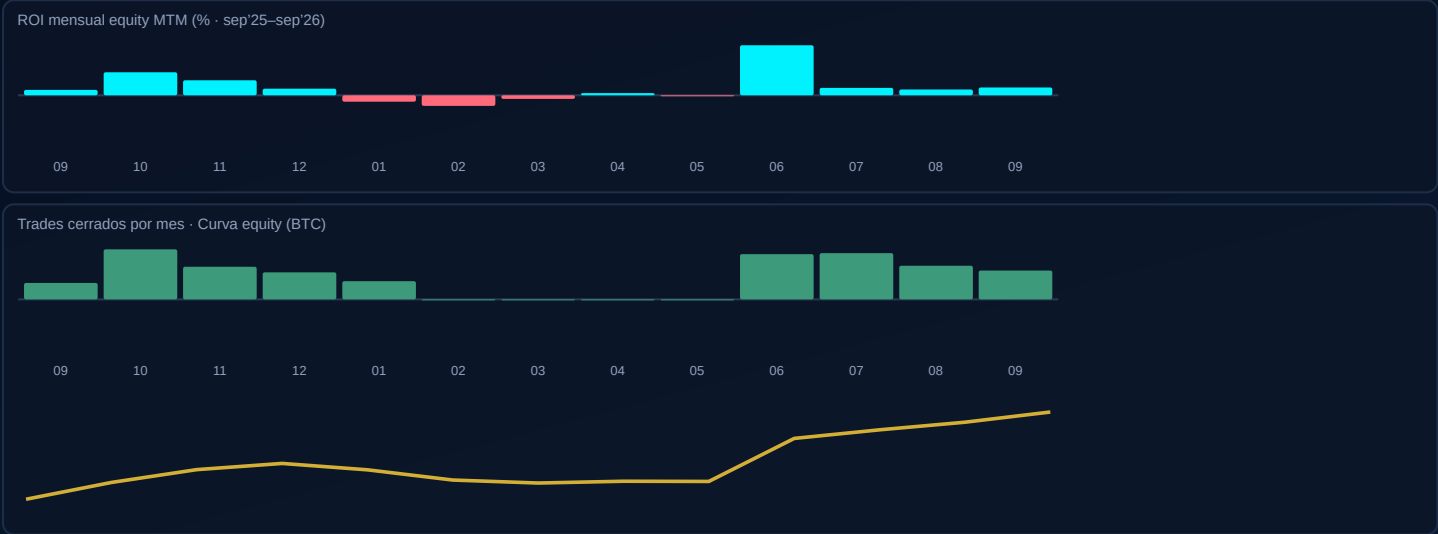
Saldo inicio → bot hoy

+82,3 k\$

Extra vs solo guardar BTC

310 trades

Cierres (WR 100 % en quote)



DETALLE POR MES

MES	TRADES	ROI MES	EQUITY	DD ACUM.	LECTURA
2025-09*	17	+4,3 %	1,042	0 %	Parcial desde 19
2025-10	52	+17,8 %	1,228	0 %	Mejor arranque
2025-11	34	+11,6 %	1,370	0 %	Ratio sube
2025-12	28	+5,0 %	1,439	1,6 %	Sigue rotando
2026-01	19	-5,0 %	1,368	12,2 %	MTM a la baja
2026-02	0	-8,3 %	1,255	19,5 %	Sin cierres
2026-03	0	-2,7 %	1,221	21,7 %	DD pico del año
2026-04	0	+1,8 %	1,242	20,3 %	Lateral
2026-05	0	-0,4 %	1,238	20,6 %	Lateral
2026-06	47	+38,7 %	1,716	15,2 %	Reactivación
2026-07	48	+5,7 %	1,813	15,2 %	Alta rotación
2026-08	35	+4,5 %	1,896	15,2 %	Sigue
2026-09*	30	+6,0 %	2,010	15,2 %	Parcial · pos. abierta

Lectura: con capital fresco el motor ×2 en BTC (+101 %) y +42 % USD mientras BTC cae -30 %. Feb–may 2026: 0 trades y DD ~22 % (seguía en miniatura). Buy&hold del ratio (+172 % BTC) bate al bot en tendencia alcista fuerte.

Qué funcionó

Sep–dic'25 y jun–sep'26: hasta 52 trades/mes y +1,02 BTC realizados. Frente a guardar BTC en año bajista, el bot protege y multiplica el saldo en quote (+82 k\$ vs hold).

Qué falló / matiz

Hueco feb–may sin cierres. El ratio en tendencia deja alpha sobre la mesa vs buy&hold. Misma familia de riesgo que el estudio 5 años, ventana más corta.