



Backtest 5 años — 1 BTC de saldo inicial

Simulación 19 sep 2021 → 19 sep 2026 · 43.942 velas 1h · maker 0,05 % · margen ATR 0,35–0,9 % · sin compound · sin withdraw · fill lowsbuy / highsells. Misma lógica que el Bot IA vivo (cuenta XXL KuCoin).

+70,5 %

ROI en BTC (MTM)

1,705 BTC

Equity final

139.109 \$

Valor USD hoy

42,4 %

Max drawdown

RESUMEN — PARTISTE CON 1 BTC HACE 5 AÑOS

BTC/USD: 47.242,5 \$ (19-sep-2021) → 81.589,8 \$ (19-sep-2026). Apertura = 47.243 \$.

QUÉ PASÓ CON ESE 1 BTC	SALDO BTC	VALOR USD	VS APERTURA
Apertura · 19 sep 2021	1,000 BTC	47.243 \$	—
Tras 5 años con el Bot IA (MTM)	1,705 BTC	139.109 \$	+91.867 \$ · +194,5 %
Si hubieras guardado el 1 BTC sin operar	1,000 BTC	81.590 \$	+34.347 \$ · +72,7 %
Buy&hold del ratio XMR/BTC	≈1,236 BTC	100.829 \$	+53.586 \$ · +113,4 %

1 → 1,705 BTC

Saldo inicio → bot hoy

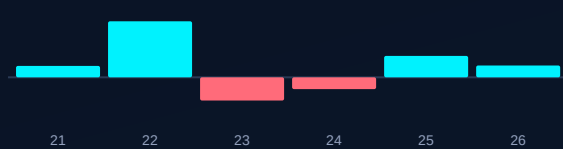
+57,5 k\$

Extra vs solo guardar BTC

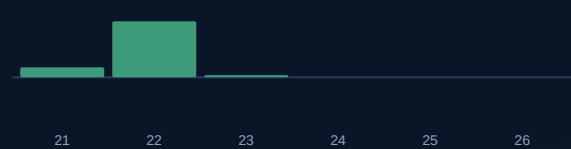
379 trades

Cierres (WR 100 % en quote)

ROI anual bot vs buy&hold ratio (%/año)



Trades cerrados por año



Curva equity MTM (muestra trimestral, BTC)



DETALLE POR AÑO CALENDARIO

AÑO	TRADES	ROI BOT	BUY&HOLD	MAX DD	HOLD MEDIO	LECTURA
2021*	56	+14,0 %	−12,1 %	19,3 %	39 h	Parcial sep–dic
2022	311	+68,9 %	+80,2 %	24,2 %	19 h	Mejor año operativo
2023	12	−28,5 %	−56,1 %	29,4 %	10 h	Sequía: queda en posición
2024	0	−14,5 %	−47,2 %	19,3 %	—	Solo MTM · DD acumulado pico
2025	0	+26,4 %	+139 %	14,8 %	—	Rebote ratio, sin cierres
2026*	0	+14,5 %	+40,3 %	21,9 %	—	Parcial ene–sep · pos. abierta

Hallazgo: el 93 % del tiempo la sim está en posición. Tras 2022 (311 cierres) casi no hay ventas: el ratio cae y el target queda fuera. El +70,5 % global es sobre todo mark-to-market del inventario. Un backtest 1 año «fresco» no ve esta sequía — el de 5 años sí. Implica anti-sequía de venta en el roadmap (sin volver a scalp+TTL a mercado).

Qué funcionó

2021–22: mean-reversion + scale 50 %×2 → 367 cierres y +0,93 BTC realizados. En 2022 el bot casi iguala el rally del ratio con ~26 trades/mes. Cierres siempre con margen > fees.

Qué falló

Desde fin de 2023: 0 trades 2024–26. Equity cae con el ratio (DD pico ~42 % nov-2024) y solo recupera cuando XMR/BTC sube. WR 100 % no cuenta el inventario atrapado.