

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX SEMANA 13 [24/3/2025 – 28/3/2025] – SEMANA MIXTA, SEGUIR EL PLAN Y ADAPTARSE

Bienvenidos a una nueva edición de nuestro boletín semanal, donde seguimos evaluando el rendimiento de nuestras estrategias neutrales sobre el índice SPX, con base en datos, estadísticas y gestión de riesgo.

Resumen Semanal

La semana 13 nos dejó un balance general de **-\$290.00**, pero también varios puntos positivos para destacar. La estrategia **IB 10:30 w40** volvió a destacarse con una sólida ganancia de **\$1,200.00**, consolidándose como la más fuerte del sistema en este contexto. Además, **IB 9:30 w30** logró cerrar la semana en verde, mostrando señales de mejora tras varias semanas difíciles. Aunque otras estrategias cerraron en negativo, estos contrastes refuerzan la importancia de seguir analizando cada configuración de forma individual, reconociendo lo que funciona, ajustando lo que no, y siempre respetando el plan respaldado por datos.

El siguiente cuadro detalla el comportamiento de los **Iron Butterflies** de esta semana que acaba de terminar:

	9:30 w30	9:30 w50	9:40 w40	10:30 w40	11:00 w40	11:30 w40
Fri, 03/28/2025	✓	✗	✗	✓	✓	✗
Thu, 03/27/2025	✓	✗	✗	✓	✗	✗
Wed, 03/26/2025	✓	✗	✗	✓	✗	✗
Tue, 03/25/2025	✓	✓	✓	✓	✗	✗
Mon, 03/24/2025	✗	✗	✓	✓	✓	✓

TP	\$40	\$320	\$180	\$240	\$180	\$320
SL	-\$110	-\$170	-\$330	-\$150	-\$210	-\$150
GANANCIA/PERDIDA	\$50.00	-\$360.00	-\$630.00	\$1,200.00	-\$270.00	-\$280.00

Análisis de Estrategias

IB 9:30 w30: Leve mejora

Esta estrategia logró cerrar en verde por un margen mínimo de **\$50.00**, gracias a tres días positivos. Aunque no es una ganancia significativa, es un pequeño respiro dentro de una serie de semanas difíciles. El bajo TP de \$40 sigue reflejando un enfoque conservador frente al entorno volátil.

IB 9:30 w50: Vuelve al terreno negativo

Con una pérdida de **-\$360.00**, esta estrategia no logró sostener su estabilidad. La apertura continúa siendo un horario complicado, y el algoritmo deberá reevaluar si mantener este setup.

IB 9:40 w40: Golpe duro

Fue la estrategia con peor rendimiento de la semana, acumulando **-\$630.00**. A pesar de su potencial

histórico, su configuración actual no está alineada con la dinámica del mercado. Deberá ser puesta en vigilancia inmediata.

IB 10:30 w40: Brillante nuevamente

Por segunda semana consecutiva, esta estrategia fue la más rentable con **\$1,200.00** de ganancia. Su consistencia y adaptación al mercado la convierten hoy en el pilar más sólido del sistema. Es donde deberíamos poner el foco.

IB 11:00 w40: Semana floja

Cerró con una pérdida de **-\$270.00**, afectada por tres días negativos consecutivos. Aunque venía mostrando recuperación, esta semana representa un retroceso que obliga a evaluar si es una excepción o una tendencia.

IB 11:30 w40: En descenso

Con **-\$280.00** de pérdida, esta estrategia también mostró debilidad, a pesar de haber sido una de las más sólidas en el pasado. Sumada a los resultados de la semana anterior, podría ser momento de revisar su TP/SL

IB 9:30 w30: Persisten las dificultades

Una vez más, esta estrategia fue la única en cerrar la semana en rojo, con una pérdida de **-\$550.00**. A pesar de los ajustes implementados en su TP (\$40), el mercado sigue mostrando movimientos que complican su desempeño. Continuamos monitoreándola de cerca y analizaremos si es momento de pausarla o reformular su estructura.

IB 9:30 w50: Estabilidad con leve ganancia

Repitiendo el patrón de la semana pasada, esta estrategia logró un pequeño resultado positivo de **\$10.00**. No deslumbra, pero **se mantiene firme** y sin grandes sobresaltos. En algún momento llegó a ser nuestra estrategia estrella, y si bien es la mas ganadora desde que empezó el año a regulado su comportamiento.

Comentario especial:

Durante los primeros meses, estrategias como **IB 9:30 w50** —e incluso **9:30 w30**— mostraron resultados muy sólidos y consistentes. Sin embargo, esta última etapa ha demostrado que su rendimiento ya no es el mismo. En contraste, la estrategia **10:30 w40**, que antes tenía un desempeño más discreto, ahora se ha convertido en una de las más estables y rentables del sistema.

Esto nos recuerda una verdad clave del trading: **las estrategias no son óptimas para siempre**. El mercado cambia constantemente —puede ser lateral, tendencial, de baja o alta volatilidad— y no todas las configuraciones funcionan igual en cada entorno. Por eso, es fundamental tener la flexibilidad para adaptarse, y es ahí donde el análisis estadístico y el estudio constante de datos juegan un rol decisivo. Nos permiten no solo interpretar lo que está pasando, sino también anticipar esos cambios y ajustar el plan antes de que sea demasiado tarde.

Seguimiento a los Iron Condors

	9:30 d10 w20	9:30 d10 w20
Fri, 03/21/2025	✗	✓
Thu, 03/20/2025	✓	✓
Wed, 03/19/2025	✗	✗
Tue, 03/18/2025	✓	✓
Mon, 03/17/2025	✗	✓
TP	\$160	\$100
SL	-\$150	-\$230
GANANCIA/PERDIDA	-\$130.00	\$170.00

\$130.00.

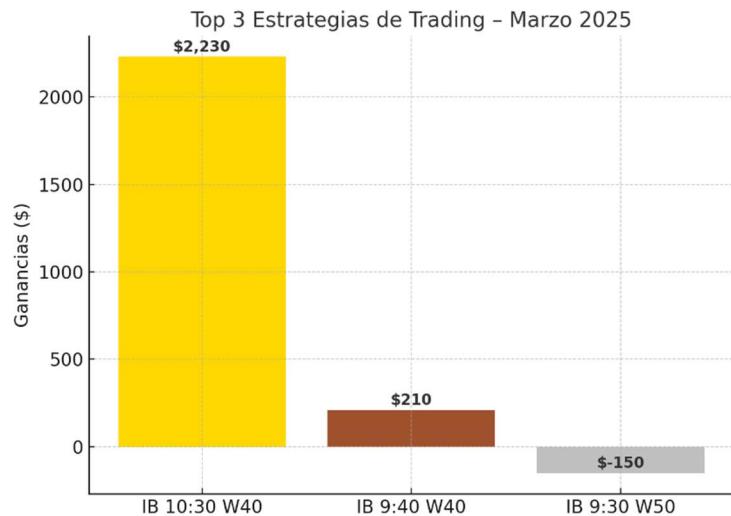
Esta diferencia refuerza algo que venimos viendo: en un entorno volátil, suele ser mejor priorizar configuraciones más equilibradas, con mayor tolerancia al ruido de mercado y menor necesidad de precisión extrema para alcanzar el TP.

Además, observamos que las estrategias de **Iron Condor lanzadas a las 10:30** también están comenzando a mostrar resultados muy sólidos. Al igual que sucede con los Iron Butterfly en ese mismo horario, parece haber una ventana donde la **volatilidad se reduce** y los **movimientos del mercado se estabilizan**, permitiendo que nuestras estrategias neutrales funcionen con mayor eficiencia. Sin duda, algo interesante está ocurriendo en ese horario y vale la pena seguir enfocándonos allí.

Resumen mensual – Marzo 2025

Si bien falta un día para terminar el mes, no creemos que influya mucho en los resultados finales. De esta manera el mes fue una clara muestra de que el mercado evoluciona, y con él, también deben hacerlo nuestras estrategias. Los resultados hablan por sí solos y refuerzan la importancia de seguir operando con base en datos y adaptabilidad.

- 🦋 **IB 10:30 W40** se consolidó como la gran ganadora del mes, acumulando una ganancia total de **\$2,230.00**. Su consistencia durante las últimas semanas confirma que este horario ofrece actualmente el mejor entorno para estrategias neutrales.



- 🦋 **IB 9:40 W40** logró mantenerse en positivo con **\$210.00**, a pesar de una semana difícil. Su desempeño fue más irregular, pero muestra que aún tiene potencial si se ajusta bien su configuración.
- 🦋 **IB 9:30 W50**, aunque cerró en negativo con **-\$150.00**, fue la tercera mejor en términos relativos, lo cual refleja que muchas otras configuraciones no lograron adaptarse a la dinámica actual del mercado.

Por otro lado, estrategias como **IB 11:00 W40 (-\$990.00)**, **IB 11:30 W40 (-\$920.00)** y **IB 9:30 W30 (-\$1,750.00)** enfrentaron un mes complicado, dejando en claro que ninguna estrategia es infalible y que su rendimiento dependerá siempre del contexto en el que se apliquen.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 14 [03/31/2025 – 04/04/2025]

Cerramos marzo con grandes aprendizajes y comenzamos abril con el compromiso de seguir operando con disciplina, adaptabilidad y foco estadístico. El algoritmo ha ajustado varias configuraciones, destacando un patrón que ya venimos observando: **el horario de las 10:30 sigue consolidándose como el más eficiente**, tanto por su consistencia como por el entorno más favorable que parece ofrecer.

Por el contrario, las estrategias de las 9:30, que habían tenido buen rendimiento en los primeros meses, siguen sin encontrar el equilibrio adecuado. El algoritmo vuelve a ajustar sus parámetros, manteniéndolas en modo conservador. Estas configuraciones deben ser monitoreadas con especial atención, y si las condiciones no cambian, podrían ser pausadas próximamente.

También es importante señalar que el horario de **11:30 w40**, a pesar de no estar en su mejor momento, mantiene un TP elevado de \$320 con un SL contenido en -\$110, lo que indica que aún hay una expectativa positiva.

A continuación, los **nuevos TP/SL detectados por el algoritmo para la semana entrante**:

🦋 9:30 W30 0DTE				🦋 9:30 W50 0DTE				🦋 9:40 W40 0DTE			
% TP		\$ SL		% TP		\$ SL		% TP		\$ SL	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
5%	-5%	140	-90	11%	-6%	320	-170	7%	-10%	180	-330
🦋 10:30 W40 0DTE				🦋 11:00 W40 0DTE				🦋 11:30 W40 0DTE			
% TP		\$ SL		% TP		\$ SL		% TP		\$ SL	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
9%	-12%	240	-310	8%	-13%	180	-210	19%	-6%	320	-110

Nota Final:

Una buena estrategia no garantiza resultados para siempre. El mercado cambia, y con él, cambian también las condiciones bajo las cuales una configuración deja de ser efectiva y otra comienza a brillar. Por eso, el verdadero valor está en la capacidad de **adaptación**, no en la rigidez.

Las estrategias que funcionaron en enero no son las mismas que están funcionando ahora. Y está bien. Eso no significa que fallamos, significa que **estamos leyendo el mercado en tiempo real y tomando decisiones con inteligencia**.

El trading estadístico no es sobre acertar siempre, sino sobre saber **cuándo ajustar, cuándo seguir y cuándo parar**. Y eso, como todo lo que hacemos acá, está guiado por datos, no por intuición.

Nos seguimos viendo semana a semana, ajustando, aprendiendo y mejorando juntos. ¡Hasta la próxima!

Descargo de Responsabilidad: Los análisis y estrategias discutidos en este boletín se proporcionan únicamente con fines informativos y educativos. El autor no se hace responsable de las decisiones de inversión tomadas en base a esta información. Las operaciones en los mercados financieros, especialmente con opciones, conllevan un riesgo significativo de pérdida y no son adecuadas para todos los inversores. Todo trading es a su propio riesgo.