

Bienvenidos al Boletín Semanal de Análítica SPX

SEMANA 17 [04/21/2025 – 04/25/2025] – SEMANA DE RECUPERACIÓN PARCIAL

Bienvenidos a una nueva edición de nuestro boletín semanal, donde seguimos analizando los resultados de nuestras estrategias neutrales sobre el índice SPX, siempre operando basados en datos, estadísticas y gestión de riesgo.

Resumen Semanal

La semana 17 comenzó de forma complicada, con varios días consecutivos donde el mercado mostró **alta dispersión** y movimientos erráticos que sacudieron a casi todas nuestras configuraciones.

Sin embargo, el **viernes 25** trajo una recuperación importante: todas las estrategias lograron cerrar la jornada en verde, **reduciendo las pérdidas acumuladas** y mostrando que, incluso en semanas difíciles, mantener el plan permite aprovechar los momentos de reversión.

Fue una semana exigente, que refuerza un principio básico: **no importa cómo empieza, importa cómo seguimos ejecutando**.

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, 04/25/2025	☑	☑	☑	☑	☑	☑
Thu, 04/24/2025	✗	✗	✗	✗	✗	☑
Wed, 04/23/2025	✗	✗	☑	✗	✗	☑
Tue, 04/22/2025	✗	✗	✗	✗	✗	✗
Mon, 04/21/2025	✗	✗	✗	✗	☑	☑
TP	\$140	\$320	\$220	\$240	\$40	\$80
SL	-\$90	-\$170	-\$90	-\$210	-\$50	-\$250
GANANCIA/PERDIDA	-\$220.00	-\$360.00	\$170.00	-\$600.00	-\$70.00	\$70.00

Análisis de Estrategias Iron Butterflies

IB 9:30 w30 – Semana negativa

Registró una pérdida de **-\$220.00**.

A pesar del acierto del viernes, la acumulación de SLs durante los primeros días pesó demasiado. El bajo TP la vuelve más sensible a movimientos bruscos tempranos.

IB 9:30 w50 – Golpeada pero en observación

Terminó la semana con **-\$360.00**.

Fue una de las más afectadas por la volatilidad media de la semana. Aunque históricamente es sólida, sigue bajo vigilancia hasta confirmar recuperación consistente.

IB 9:40 w40 – Resistente

Logró cerrar con **\$170.00** de ganancia.

Fue la mejor estrategia de la semana, aguantando mejor las turbulencias y demostrando que su ajuste de SL más amplio sigue dando frutos en semanas complicadas.

IB 10:30 w40 – Difícil semana

Acumuló una pérdida de **-\$600.00**, la más grande entre todas las configuraciones.

No logró capitalizar los rebotes, y sigue mostrando que su mejor momento es en mercados más ordenados.

IB 11:00 w40 – Pérdida acotada

Cerró en **-\$70.00**.

Dentro del contexto general, fue un daño moderado. Su SL muy ajustado (-\$50) ayudó a limitar pérdidas.

IB 11:30 w40 – Estabilidad y resiliencia

Sumó **\$70.00** de ganancia, mostrando una resiliencia inesperada esta semana.

Aunque históricamente más volátil, esta vez logró contener los movimientos y terminar en verde.

Conclusión

La semana 17 fue una de esas que **ponen a prueba la paciencia y la disciplina**.

Durante la mayor parte de la semana, el mercado se mostró errático:

Movimientos desordenados, sin tendencias claras, con idas y vueltas que complicaron el desempeño de la mayoría de nuestras estrategias.

En ese tipo de entornos, **ninguna estructura neutral es inmune**: lo importante no es evitar las pérdidas, sino **gestionar el riesgo, mantener el plan y estar listos cuando las condiciones mejoran**.

El **viernes 25** fue una demostración de por qué **no abandonamos el proceso en medio del ruido**:

Todas las estrategias cerraron en verde ese día, lo que permitió **reducir significativamente las pérdidas de la semana** y, en algunos casos como **9:40 w40** y **11:30 w40**, **cerrar incluso en positivo**.

Este tipo de semanas nos recuerdan algo fundamental:

No se trata de operar solo cuando todo va perfecto. Se trata de construir un enfoque que pueda resistir los ciclos malos y capitalizar los buenos.

Porque en el largo plazo, **no gana quien adivina el próximo movimiento**, sino quien **permanece fiel a su proceso**, sabiendo que la estadística y la disciplina siempre terminan imponiéndose.

Seguimos adelante. Una semana más, un aprendizaje más.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 18 [04/28/2025 – 05/02/2025]

El algoritmo ajustó los TP/SL de cara a la semana 18 tras el desempeño dispar de la última semana. Los movimientos principales que se detectan son:

- **Las estrategias de apertura (9:30 h)** se mantienen prácticamente estables.
- **9:40 w40** muestra un **ajuste interesante en el TP**, subiéndolo a **\$300** (desde \$220 anteriormente). El sistema reconoce que esta estrategia resistió bien y ahora le otorga más espacio para capturar recorridos.
- **10:30 w40** ajusta a la baja. Baja su TP de **\$240 a \$180** y amplía su SL de **-210 a -230**, reflejando que necesita más flexibilidad, pero sin buscar grandes ganancias.
- **11:00 w40** mantiene parámetros similares, priorizando protección extrema, ya que sigue bajo estricta vigilancia.
- **11:30 w40** sigue igual: estructura conservadora, enfocada en limitar daños en caso de movimientos bruscos.

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

%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
5%	-5%	140	-90	9%	-5%	320	-170	7%	-10%	300	-90
 10:30 W40 ODTE				 11:00 W40 ODTE				 11:30 W40 ODTE			
%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
9%	-7%	180	-230	6%	-8%	40	-50	17%	-9%	80	-250

Nota Final:

La semana 17 nos recordó una verdad fundamental del trading estadístico: **no siempre se gana, pero siempre se aprende.**

Fue una semana desafiante, donde el mercado presentó movimientos erráticos que golpearon a muchas de nuestras estrategias. Sin embargo, la recuperación del viernes demostró por qué **la clave no está en evitar las semanas malas, sino en tener la estructura y la mentalidad para atravesarlas.**

Algunas estrategias, como **9:40 w40** y **11:30 w40**, mostraron resiliencia. Otras, como **9:30 w50** o **10:30 w40**, todavía están ajustándose al nuevo entorno.

El algoritmo, como vimos en los ajustes para la semana entrante, responde de manera inteligente: refuerza donde hay solidez, protege donde hay vulnerabilidad.

Este es el verdadero poder de operar con datos:

No forzamos. No adivinamos. No improvisamos. Seguimos leyendo el mercado, ejecutamos según el plan, y dejamos que las estadísticas trabajen a nuestro favor en el largo plazo.

Cada semana difícil que atravesamos **fortalece más nuestro proceso**, porque nos entrena para actuar con lógica, no con emociones.

Seguimos adelante, con la misma disciplina, el mismo enfoque y la confianza intacta en que **lo que estamos construyendo tiene sentido.**

¡Nos vemos la próxima semana!

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.