

Bienvenidos al Boletín Semanal de Análítica SPX

SEMANA 18 [04/28/2025 – 05/02/2025] – SEMANA TRANQUILA Y POSITIVA

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 18 comenzó con un entorno poco favorable: baja direccionalidad, movimientos erráticos y muchas velas violentas que activaban SL rápidamente. Sin embargo, hacia el viernes, el mercado mostró un rebote técnico fuerte que permitió recuperar parte del terreno perdido.

Lo más destacado fue la solidez de las estrategias de apertura, en especial las **9:30**, que volvieron a confirmar su capacidad de adaptarse incluso en semanas difíciles. A pesar de que el balance general fue mixto, hubo configuraciones que brillaron y otras que no tanto.

A pesar de varias estrategias en rojo, el resultado **neto fue positivo**, gracias al excelente rendimiento de las configuraciones de apertura (especialmente 9:30 w50). Este resultado respalda la importancia de mantener una cartera diversificada de horarios y seguir el sistema con disciplina.

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, 05/02/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✗
Thu, 05/01/2025	✓	✓	✗	✓	✓	✗
Wed, 04/30/2025	✗	✗	✗	✗	✗	✓
Tue, 04/29/2025	✗	✗	✗	✗	✗	✓
Mon, 04/28/2025	✓	✓	✗	✗	✗	✓
TP	\$140	\$320	\$300	\$180	\$40	\$80
SL	-\$90	-\$170	-\$90	-\$230	-\$50	-\$250
GANANCIA/PERDIDA	\$240.00	\$620.00	-\$60.00	-\$330.00	-\$70.00	-\$260.00

Análisis de Estrategias Iron Butterflies

IB 9:30 w30 – Buen rebote tras semanas flojas

Con 3 operaciones positivas y solo 2 SLs, esta configuración volvió a demostrar su potencial. Cerró la semana con **+\$240.00**, resultado sólido considerando la inestabilidad de las jornadas del martes y miércoles.

IB 9:30 w50 – La más fuerte de la semana

Fue la mejor estrategia, con **+\$620.00** de ganancia neta. Logró capitalizar los movimientos más limpios del horario de apertura. Confirma su perfil como una de las más consistentes del sistema.

IB 9:40 w40 – Estancada en zona neutra

A pesar de los días ganadores, terminó apenas negativa con **-\$60.00**. Su TP elevado no fue suficiente para compensar las salidas por SL. Aun así, sigue mostrando cierta resiliencia.

IB 10:30 w40 – Semana débil para una estrategia estable

Tuvo una semana difícil: **-\$330.00**, afectada principalmente por los movimientos erráticos del martes y miércoles. A pesar de esto, conserva un historial fuerte a largo plazo.

IB 11:00 w40 – Pérdida controlada

Terminó con **-\$70.00**, muy por debajo de su SL máximo, lo que sugiere que sus ajustes están funcionando. No brilló, pero tampoco comprometió el capital de forma significativa.

IB 11:30 w40 – La más inestable

Aunque logró 3 días ganadores, sus SL más profundos provocaron un cierre negativo de **-\$260.00**. Requiere seguimiento, ya que su ratio riesgo/beneficio puede no estar alineado al entorno actual.

Análisis de Estrategias Iron Condors

IC 9:30 d10 w20 - Una semana excepcional: 5 días operativos, 5 aciertos.

Ganancia total: **+\$800.00**. Este tipo de racha es poco común, y demuestra cómo en entornos con menos sobresaltos direccionales, los IC pueden aprovechar la estabilidad y generar retornos sostenidos. Es una estrategia que prioriza la calma y la amplitud, y esta semana funcionó de manera impecable.

IC 9:30 d10 w20 – Tranquila y rendidora

Más moderada en expectativas, pero también cerró en positivo: **+\$100.00**

Tuvo dos stops al inicio de la semana, pero se recuperó con tres aciertos consecutivos. Es una configuración más conservadora, que se adapta bien cuando el mercado no muestra violencia.

Conclusión

La semana 18 cerró con un mensaje claro: **cuando se respeta el plan, los resultados llegan.**

A pesar de un comienzo irregular, el sistema demostró su solidez, especialmente el viernes, donde varias estrategias brillaron y ayudaron a consolidar una semana positiva en términos netos. No todas las configuraciones cerraron en verde, pero el enfoque diversificado y estadístico mostró nuevamente su valor.

Las estrategias de **Iron Condor** mantuvieron una **consistencia destacable** durante toda la semana, sumando cinco días operativos con muy buen rendimiento. Por su parte, las **Iron Butterfly de apertura (9:30 w30 y w50)** volvieron a confirmar por qué son una piedra angular del sistema.

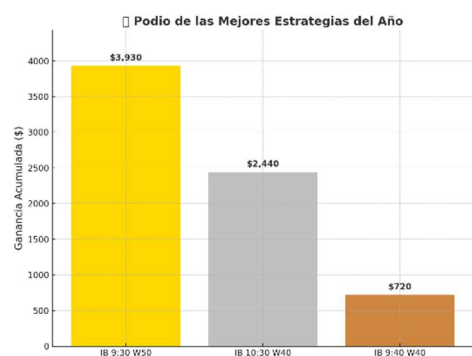
 **Balance total combinado (IB + IC): +\$1,040.00**

Este tipo de semanas nos recuerdan que no se trata de ganar todos los días, sino de construir una curva sostenida a lo largo del tiempo, donde cada operación esté respaldada por datos, gestionada con disciplina, y ejecutada con enfoque.


Lo importante no es evitar los días negativos, sino mantenernos operando dentro de una estructura que nos permita estar presentes cuando el mercado sí ofrece oportunidades claras.

Seguimos adelante, con confianza en el proceso y la mirada puesta en el largo plazo.


Podio de Estrategias IB – Acumulado 2025




Este gráfico muestra el rendimiento acumulado de las tres mejores *Iron Butterflies* del año hasta la fecha, evidenciando cómo la disciplina, la estadística y los ajustes estratégicos dan sus frutos en el mediano y largo plazo.

 **IB 9:30 W50** se lleva el primer lugar por amplio margen, superando los **\$3,900** en ganancias netas. Esta estrategia, que opera con alas más amplias (50 puntos), demuestra que **extender el rango de protección puede ofrecer grandes ventajas**, especialmente en semanas con movimientos

amplios pero controlados. Su estabilidad a lo largo del año la convierte en **el pilar más confiable de nuestro sistema hasta ahora.**

 **IB 10:30 W40** continúa mostrando un rendimiento sólido y parejo, acumulando más de **\$2,400**, confirmando que el entorno de media mañana sigue siendo valioso cuando el mercado se estabiliza.

 **IB 9:40 W40** cierra el podio con **\$720**, destacándose por su capacidad de aprovechar ventanas cortas de oportunidad, aunque con mayor exposición a la volatilidad de la apertura.




En conjunto, estos datos validan el enfoque estructurado que venimos aplicando: cuando cada estrategia se respeta en su horario, configuración y lógica, los resultados se manifiestan.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 19 [05/05/2025 – 05/09/2025]

Tras evaluar los nuevos parámetros de TP/SL ajustados por el algoritmo para la próxima semana, se destacan varias observaciones importantes que nos ayudan a decidir con mayor claridad cuáles estrategias tienen mejor perfil de riesgo-beneficio en el contexto actual.

- ◆ **IB 9:30 W50** sigue siendo, sin lugar a dudas, la estrategia más robusta del sistema. A pesar del ajuste a un SL más amplio (-\$250), mantiene un TP atractivo de \$320, lo que confirma su perfil ganador y su capacidad para sostener resultados incluso en semanas difíciles. Es una estrategia confiable para seguir priorizando.
- ◆ **IB 9:40 W40** muestra un TP alto (\$200), pero también un SL elevado (-\$310). Esto indica una mayor exposición al riesgo, y si bien puede rendir bien en días favorables, requiere precaución adicional si el mercado muestra signos de aumento en la volatilidad.
- ◆ **IB 10:30 W40** ha sido ajustada con un TP más conservador (\$100) y un SL de -\$210. La relación riesgo/beneficio no es la más favorable, por lo que esta estrategia se mantendría en observación.
- ◆ Las estrategias de media mañana como **IB 11:00 W40** y **IB 11:30 W40** siguen mostrando un perfil riesgoso con TP muy bajos (\$40) frente a SLs elevados (-\$270 y -\$250 respectivamente). Recomendamos **limitar su uso o incluso pausarlas temporalmente**, al menos hasta que los datos muestren señales más firmes de recuperación.
- ◆ En cambio, **IB 9:30 W30** sigue siendo una alternativa sólida y controlada, con TP de \$140 y SL ajustado a -\$90. Si bien no ofrece grandes ganancias, su estabilidad la convierte en una buena opción para quienes buscan menor exposición.

✚ Resumen

-  **Estrategias recomendadas:** 9:30 W50 (principal), 9:30 W30 (secundaria controlada).
-  **Estrategias en observación:** 9:40 W40, 10:30 W40.
-  **Estrategias a evitar por ahora:** 11:00 W40, 11:30 W40.

Como siempre, cada recomendación parte del análisis objetivo de datos y rendimiento, sin intuiciones ni especulaciones.

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
5%	-5%	140	-90	9%	-7%	320	-250	7%	-11%	200	-310

🦋 10:30 W40 0DTE				🦋 11:00 W40 0DTE				🦋 11:30 W40 0DTE			
%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
6%	-8%	100	-210	5%	-8%	40	-270	17%	-9%	40	-250

Nota Final:

Esta semana fue una prueba más de por qué seguimos firmes en el camino de las estrategias sistemáticas. Aunque el mercado ofreció varios días complicados, con movimientos erráticos y difíciles de anticipar, el **balance total volvió a ser positivo**, gracias al desempeño sólido de configuraciones clave como **IB 9:30 W50**, que sigue confirmando su lugar como líder del sistema.

A esto se suma el excelente rendimiento de los **Iron Condors**, que aportaron estabilidad y reforzaron el resultado general. En conjunto, ambas estructuras no solo compensaron las pérdidas, sino que dejaron una semana más en verde.

Pero lo más importante no son los números, sino el **proceso**. Porque cada semana nos recuerda que:

- No se trata de evitar las pérdidas, sino de saber gestionarlas.
- No ganamos por predecir, sino por mantenernos fieles a una lógica basada en datos.
- Y sobre todo, que **la constancia es más poderosa que cualquier acierto aislado**.

El sistema funciona porque respeta sus reglas incluso en entornos adversos, y porque está diseñado para **resistir, aprender y evolucionar**. A veces ganamos, otras veces ajustamos... pero siempre seguimos.

Semana a semana, paso a paso, seguimos construyendo algo que va mucho más allá de una racha buena o mala: estamos construyendo **consistencia a largo plazo**.

Nos vemos en el próximo boletín.

Seguimos adelante. Siempre con datos, nunca con corazonadas.

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.