

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX SEMANA 21 [19/05/2025 – 23/05/2025]

COMO EN LOS BUENOS TIEMPOS

Comenzamos una nueva entrega del boletín semanal, donde continuamos evaluando y afinando nuestras estrategias neutrales en el índice SPX, siempre con un enfoque basado en datos, análisis estadístico y ejecución consistente.

RESUMEN SEMANAL

Otra semana positiva para nuestro sistema. Las condiciones del mercado ofrecieron estructura, consistencia y oportunidades claras que fueron bien aprovechadas por nuestras estrategias. Las combinaciones estadísticamente más sólidas volvieron a responder, confirmando que el enfoque disciplinado y basado en datos sigue dando frutos.

El **balance total de las 6 estrategias Iron Butterfly** cerró con una ganancia neta de **\$1,970.00**, con destacadas actuaciones nuevamente de las estrategias de apertura como **9:30 w50** y una excelente performance de **10:30 w40**.

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

Día	9:30 w30	9:30 w50	9:40 w40	10:30 w40	11:00 w40	11:30 w40
Mon, 05/19/2025	✗	✗	✗	✓	✓	✗
Tue, 05/20/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Wed, 05/21/2025	✓	✓	✓	✓	✗	✓
Thu, 05/22/2025	✓	✓	✗	✓	✓	✗
Fri, 05/23/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✓
GANANCIA/PERDIDA	\$ 570.00	\$ 970.00	\$ 460.00	\$ 500.00	\$ (110.00)	\$ (420.00)

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS - IRON BUTTERFLIES

IB 9:30 W30 – Sigue sumando con solidez

Con 4 de 5 días positivos, esta configuración continúa mostrando estabilidad y eficiencia en la apertura. Cerró con una ganancia semanal de **\$570.00**, validando su perfil confiable incluso cuando el mercado presenta ciertas irregularidades.

IB 9:30 W50 – Una vez más, la más rentable

Acumuló **\$970.00** en la semana, reafirmando su lugar como la estrategia estrella del sistema. No

solo fue consistente, sino que logró capitalizar cada oportunidad. Extender las alas, como propone esta configuración, sigue demostrando su efectividad a largo plazo.

IB 9:40 W40 – Recuperación sostenida

Después de algunas semanas mixtas, esta estrategia volvió al terreno verde con **\$460.00** de ganancia. Aunque tuvo un pequeño tropiezo el jueves, logró responder bien el resto de los días. Se mantiene en observación, pero con buen rendimiento.

IB 10:30 W40 – Semana muy positiva

Sumó **\$500.00** con 4 días ganadores y un solo SL, lo que demuestra que este horario continúa siendo uno de los más eficientes. El equilibrio entre su TP moderado y su fiabilidad intradiaria la convierte en una gran opción para semanas como esta.

IB 11:00 W40 – Control de riesgo en marcha

A pesar de tener 4 días positivos, terminó con una pérdida leve de **-\$110.00**, debido a un SL fuerte. Sin embargo, este resultado es muy contenido, lo que muestra que los ajustes recientes están funcionando. Suma para la estabilidad general del sistema.

IB 11:30 W40 – Volatilidad que pesa

Cerró con una pérdida de **-\$420.00**, afectada por dos SL amplios que borraron las ganancias de tres días exitosos. Esta estrategia sigue teniendo un TP atractivo, pero sus SL amplios requieren cautela. Por ahora, sigue bajo monitoreo.

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS - IRON CONDORS

Día	9:30 d10 w20	10:30 d10 w20
Mon, 05/19/2025	✗	✓
Tue, 05/20/2025	✓	✓
Wed, 05/21/2025	✗	✓
Thu, 05/22/2025	✓	✓
Fri, 05/23/2025	✓	✓
GANANCIA/PERDIDA	\$ 140.00	\$ 200.00

IC 9:30 D10 W20 – Rendimiento moderado, pero firme

A pesar de comenzar con dos días negativos (lunes y miércoles), esta estrategia logró revertir la situación y cerrar la semana con una ganancia de **\$140.00**. Esta configuración mantiene su valor como una opción sólida para quienes buscan estructuras menos exigentes y con exposición controlada.

IC 10:30 D10 W20 – Consistente y estable

Con 5 días positivos, cerró la semana con **\$200.00** de ganancia. Su rendimiento fue lineal y predecible, lo que refuerza la idea de que el horario de las 10:30 continúa siendo uno de los más eficaces para estructuras neutrales como los Iron Condors (y también Iron Butterflies). Ideal para entornos de volatilidad intermedia.

CONCLUSION

Una semana más que reafirma lo que venimos trabajando hace meses: la constancia, el enfoque estadístico y la diversificación estratégica son claves para construir resultados sostenibles.

Si bien no todas las configuraciones cerraron en verde —como ocurrió con las estrategias de media mañana—, el sistema logró un **balance neto positivo** gracias al excelente rendimiento de las estrategias de apertura (en especial **IB 9:30 W50**) y la solidez que continúan mostrando los **Iron Condors**, sobre todo en el horario de las **10:30**.

 **Balance total combinado (IB + IC): +\$1,920.00**

Más allá de los números, lo importante es el proceso:

- No se trata de ganar todos los días.
- Se trata de seguir el plan incluso en semanas mixtas.
- De confiar en los datos por encima de las emociones.

Cada semana nos permite ajustar, aprender y validar que las decisiones tomadas no responden a corazonadas, sino a evidencia concreta.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 22 [05/27/2025 – 05/30/2025]

Si bien la semana que viene es una semana corta por el feriado del día lunes 26, el algoritmo actualizó los valores óptimos de **Take Profit** y **Stop Loss** para todas las estrategias activas. Los nuevos ajustes reflejan no solo los resultados recientes, sino también las condiciones de mercado proyectadas para la próxima semana.

Estrategia	TP	SL
IB 09:30 30W	\$ 200.00	\$ (230.00)
IB 09:30 50W	\$ 320.00	\$ (310.00)
IB 09:40 40W	\$ 220.00	\$ (310.00)
IB 10:30 40W	\$ 100.00	\$ (290.00)
IB 11:00 40W	\$ 40.00	\$ (90.00)
IB 11:30 40W	\$ 40.00	\$ (270.00)
IC 09:30 d10 w20	\$ 140.00	\$ (70.00)
IC 10:30 d10 w20	\$ 40.00	\$ (210.00)

◆ **IB 9:30 W50** conserva su rol protagonista. A pesar de tener el SL más amplio del sistema (-\$310), su TP de \$320 sigue siendo altamente competitivo. Es una estrategia que ha demostrado consistencia y vale la pena seguir priorizándola.

◆ **IB 9:40 W40** también mantiene un perfil agresivo, con TP alto (\$220) pero SL igualmente elevado (-\$310). Está diseñada para entornos con más direccionalidad. Requiere mayor atención si el mercado no entra en fase lateral.

◆ **IB 9:30 W30 y IB 10:30 W40** se consolidan como configuraciones estables. Ambas ofrecen buenos TPs (\$200 y \$100 respectivamente) con niveles de SL que, aunque amplios, están justificados por su comportamiento histórico favorable.

◆ **IB 11:00 W40** ajustó su SL a un valor más acotado (-\$90), lo que sugiere una búsqueda de mayor protección frente a su bajo TP (\$40). Ideal para perfiles más conservadores que buscan diversificación.

◆ En contraste, el **Iron Condor de las 9:30** continúa como una excelente alternativa: TP de \$140 con SL controlado de -\$70, lo que le da un perfil equilibrado y una muy buena tolerancia al entorno actual.

📌 Resumen

- ✅ Estrategias destacadas: IB 9:30 W50, IB 9:30 W30, IC 9:30 d10 w20, IB 9:40 W40, IB 10:30 W40
- ❌ Estrategias a evitar por ahora: IB 11:00 W40, IB 11:30 W40

📌 NOTA FINAL

La semana 21 reafirmó el poder de la estadística y la disciplina en el trading. En un entorno estable y sin sobresaltos notables, el sistema respondió como esperamos: con orden, consistencia y resultados positivos.

De las ocho estrategias activas, seis cerraron en verde y el balance total combinado volvió a ser favorable. El trabajo conjunto de las Iron Butterfly y los Iron Condor dejó en claro que una estructura

diversificada puede generar solidez aún cuando algunas configuraciones atraviesan momentos menos rentables.

No buscamos evitar las pérdidas, porque forman parte del juego. Lo importante es gestionarlas bien, mantener el foco en el plan, y permitir que las semanas ganadoras compensen aquellas menos favorables.

El ajuste dinámico de TP y SL sigue siendo clave. Estrategias como IB 9:30 W50 y 10:30 W40 demostraron una vez más por qué son pilares del sistema, mientras otras, como IB 11:30 W40, siguen en fase de revisión sin urgencias ni dramatismos.

En definitiva, fue otra semana en la que la lógica del sistema se impuso a la intuición, y los resultados hablaron por sí solos.

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.