

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX SEMANA 23 [06/02/2025 – 06/06/2025]

AJUSTES, PACIENCIA Y FOCO EN EL PROCESO

Bienvenidos a una nueva edición del boletín semanal, donde seguimos evaluando el rendimiento de nuestras estrategias neutrales sobre el índice SPX. Lo hacemos con un enfoque 100% basado en datos, modelos estadísticos y una ejecución disciplinada.

RESUMEN SEMANAL

La semana 23 trajo desafíos puntuales, pero también oportunidades que permitieron a varias configuraciones mantenerse firmes e incluso cerrar en positivo. Como siempre, más allá del resultado individual de cada estrategia, lo importante es sostener un sistema que pueda adaptarse, controlar riesgos y capitalizar escenarios favorables.

El balance total de las 6 estrategias **Iron Butterfly** cerró con una pérdida moderada de **-\$570.00**, resultado que sigue dentro del rango previsto según la lógica estadística del sistema. Esta semana nos recuerda que las pérdidas son parte del proceso, y lo importante es seguir operando con datos, sin desviarse del plan.

Cada semana es una pieza más del rompecabezas. Lo que construimos no se mide en días aislados, sino en la curva que dibuja nuestro enfoque consistente. Y en ese sentido, seguimos avanzando con foco y claridad.

A continuación, el detalle del comportamiento semanal de los **Iron Butterflies**:

Día	9:30 w30	9:30 w50	9:40 w40	10:30 w40	11:00 w40	11:30 w40
Mon, 06/02/2025	✗	✗	✓	✓	✗	✗
Tue, 06/03/2025	✗	✗	✓	✓	✗	✗
Wed, 06/04/2025	✓	✓	✗	✓	✗	✗
Thu, 06/05/2025	✓	✓	✗	✗	✓	✓
Fri, 06/06/2025	✓	✗	✗	✓	✗	✗
GANANCIA/PERDIDA	\$140.00	\$ (290.00)	\$ (490.00)	\$ 110.00	\$ (160.00)	\$ 120.00

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS - IRON BUTTERFLIES

IB 9:30 W30 – Semana discreta pero controlada

Logró cerrar con una ganancia leve de **\$140.00**, destacando con tres jornadas positivas hacia el final de la semana. Aunque el arranque fue flojo, la estrategia mantuvo el control y confirmó su estabilidad en la apertura.

IB 9:30 W50 – Semana compleja para la líder

Registró una pérdida de **-\$290.00**, cortando momentáneamente su racha positiva. A pesar del revés, su historial sigue siendo el más fuerte del sistema, y este resultado está dentro del rango tolerable para una estrategia con alto TP.

IB 9:40 W40 – Bajo rendimiento, pero aún con fundamentos sólidos

Tuvo una semana difícil, acumulando **-\$490.00** con tres SL consecutivos. Si bien es un resultado negativo, su performance previa permite mantenerla en observación sin ajustes drásticos.

IB 10:30 W40 – Positiva y confiable, una vez más

Cerró la semana con una ganancia de **\$110.00**, gracias a una excelente tasa de acierto: 4 victorias sobre 5. Su consistencia sigue haciendo de este horario una pieza clave del sistema.

IB 11:00 W40 – Retroceso moderado con señales de mejora

Aunque perdió en cuatro de cinco días, el impacto fue limitado, finalizando con **-\$160.00**. La reducción en el SL ayudó a contener pérdidas, y se observa un mayor control en comparación con semanas anteriores.

IB 11:30 W40 – Pequeña sorpresa positiva

A pesar de las condiciones adversas, esta estrategia cerró con **\$120.00** de ganancia, impulsada por las sesiones positivas del jueves y viernes. Buen indicador de que los ajustes están empezando a dar frutos.

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS - IRON CONDORS

Día	9:30 d10 w20	10:30 d10 w20
Mon, 06/02/2025	✓	✓
Tue, 06/03/2025	✗	✓
Wed, 06/04/2025	✓	✓
Thu, 06/05/2025	✗	✓
Fri, 06/06/2025	✗	✓
GANANCIA/PERDIDA	\$ (50.00)	\$ 500.00

IC 9:30 D10 W20 – Resultados mixtos, pérdida controlada

Tuvo una semana inestable, cerrando con una pérdida leve de **-\$50.00**. Con dos victorias y tres derrotas,

el balance es aceptable dentro de su perfil de riesgo reducido. El comportamiento errático de los primeros minutos del mercado afectó la estrategia, pero el SL ajustado ayudó a contener el impacto.

IC 10:30 D10 W20 – Semana impecable y gran desempeño

Cerró con una ganancia notable de **\$500.00**, gracias a cinco días consecutivos de éxito. Esta consistencia confirma que el horario de 10:30 sigue siendo uno de los entornos más favorables para esta estructura, especialmente en semanas donde el mercado tiende a estabilizarse pasado el primer impulso de apertura.

CONCLUSION

La semana 23 nos recordó algo importante: no todas las semanas van a brillar, pero cuando operamos con estructura y disciplina, incluso los momentos difíciles son parte del plan.

Las estrategias **Iron Butterfly** cerraron con un balance total de **-\$570.00**, resultado influenciado por la falta de continuidad entre las sesiones ganadoras. Sin embargo, dos configuraciones volvieron a destacar con números positivos: **9:30 w30** sumó **\$140.00** y **10:30 w40**, una de las más estables del sistema, aportó **\$110.00**. Además, **11:30 w40** cerró en verde por segunda semana consecutiva, mostrando señales de recuperación.

Por su parte, las estrategias **Iron Condor** ofrecieron un buen soporte al sistema. La versión de **10:30 d10 w20** fue especialmente consistente, con cinco días positivos consecutivos y una ganancia total de **\$500.00**, lo que demuestra su excelente tolerancia a la estructura actual del mercado.

Balance combinado total (IB + IC): **-\$120.00**

Una semana prácticamente neutra desde lo estadístico, donde el sistema logró amortiguar el impacto de varias salidas por SL sin comprometer el capital de forma significativa. Más allá del resultado puntual, lo relevante es que las configuraciones continúan adaptándose y respondiendo según los datos.

Seguimos operando, ajustando y evaluando semana a semana.

Porque ganar no es hacerlo todos los días, sino tener un plan que nos mantenga en juego a largo plazo.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 23 [06/09/2025 – 06/13/2025]

A continuación, se muestran los mejores TP y SL generados por el algoritmo en base a datos y estadísticas de los últimos meses para la semana entrante:

Estrategia	TP	SL
IB 09:30 30W	\$ 200.00	\$ (290.00)
IB 09:30 50W	\$ 320.00	\$ (310.00)
IB 09:40 40W	\$ 320.00	\$ (330.00)
IB 10:30 40W	\$ 100.00	\$ (290.00)
IB 11:00 40W	\$ 120.00	\$ (130.00)
IB 11:30 40W	\$ 320.00	\$ (70.00)
IC 09:30 d10 w20	\$ 140.00	\$ (230.00)
IC 09:30 d15 w10	\$ 40.00	\$ (270.00)
IC 10:30 d10 w20	\$ 100.00	\$ (270.00)
IC 10:30 d15 w10	\$ 40.00	\$ (170.00)

Tras evaluar los nuevos parámetros generados por el algoritmo, se confirma la continuidad para la mayoría de las estrategias más sólidas, mientras que aquellas con mayor debilidad en semanas previas recibieron ajustes relevantes, particularmente en sus Stop Loss, priorizando control de riesgo.

◆ Iron Butterflies

IB 9:30 W30, IB 9:30 W50, IB 9:40 W40 y IB 10:30 W40 no han sufrido modificaciones. Esto refuerza la confianza del modelo en su estructura actual, a pesar de los vaivenes recientes del mercado. Se mantienen como configuraciones estables y con buen potencial estadístico.

IB 11:00 W40 muestra un cambio muy importante: el TP sube a \$120 y el SL se ajusta a -\$130. Este nuevo perfil busca aprovechar movimientos moderados pero con un nivel de protección más amplio que semanas anteriores. El sistema evalúa que esta configuración puede retomar su rendimiento sin exponerse en exceso.

IB 11:30 W40 ha sido completamente reconfigurada: mantiene un TP alto de \$320, pero reduce el SL a solo -\$70. Esta combinación representa un perfil agresivo en expectativa de ganancia, pero extremadamente controlado en pérdida. Puede resultar explosiva en jornadas favorables, pero con riesgo acotado si el entorno no acompaña.

◆ Iron Condors

IC 9:30 d10 w20 y IC 10:30 d10 w20 mantienen su TP (\$140 / \$100) y SL elevado (-\$230 / -\$270), lo que indica continuidad en su perfil de rendimiento. Son estrategias que han demostrado estabilidad en semanas anteriores, especialmente 10:30 d10.

📌 NOTA FINAL

Cerramos la **semana 23** con un mensaje importante: **una semana negativa no invalida el sistema**, sino que lo valida como un enfoque realista y estadísticamente sólido.

El **balance total combinado** fue de **-\$130.00**, una cifra moderada considerando la volatilidad intermedia y una serie de SL consecutivos en las estrategias de media mañana. Lejos de representar un retroceso

preocupante, esto refuerza el valor de contar con una **estructura diversificada**, donde cada configuración cumple su rol, y **ninguna semana depende de un único acierto**.

Porque este sistema **no busca tener razón todos los días**, sino **mantenernos dentro del juego con consistencia y gestión de riesgo**. Algunas estrategias —como **IB 10:30 W40** o **IC 10:30 d10 w20**— siguen mostrando excelente rendimiento y sostienen el sistema cuando otras atraviesan rachas menos favorables.

Y eso es precisamente lo que buscamos: **un portafolio de estrategias que se equilibre entre sí**, donde lo importante no es evitar las pérdidas, sino saber absorberlas sin comprometer el proceso.

El sistema reaccionó de inmediato con **ajustes en TP/SL** en las estrategias que lo necesitaban, sobre todo en las de las 11:00 y 11:30, que venían siendo las más volátiles. Al mismo tiempo, **las configuraciones más confiables mantienen sus parámetros**, reafirmando su robustez y su potencial a largo plazo.

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.