

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX SEMANA 24 [06/09/2025 – 06/13/2025]

RESILIENCIA ESTRATÉGICA CON RESULTADOS DESTACADOS

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 24 fue ampliamente positiva en términos de desempeño general. De las seis estrategias Iron Butterfly que monitoreamos, cinco cerraron con ganancias netas, consolidando una vez más la fortaleza de nuestras configuraciones de apertura.

El balance total semanal fue de **\$2,180.00**, destacándose con fuerza las estrategias **IB 9:30 W50** y **IB 9:40 W40**, con ganancias de **\$970.00** y **\$950.00** respectivamente. Ambas continúan validando su solidez estadística, incluso en entornos de mercado dispares.

Solo una estrategia cerró en negativo, **IB 11:00 W40**, con una pérdida de **\$400.00**. Sin embargo, al tratarse de una configuración ya en observación, este resultado no sorprende y se mantiene bajo análisis.

En conjunto, los resultados refuerzan el valor de operar con estructura diversificada: cuando una estrategia enfrenta dificultades, otras logran compensar y sostener el rendimiento global. Una semana más que confirma la robustez del sistema.

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, 06/09/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✗
Tue, 06/10/2025	✓	✓	✓	✓	✗	✗
Wed, 06/11/2025	✓	✓	✓	✓	✗	✗
Thu, 06/12/2025	✗	✗	✗	✓	✗	✓
Fri, 06/13/2025	✓	✓	✓	✗	✗	✗
GANANCIA/PERDIDA	\$ 510.00	\$ 970.00	\$ 950.00	\$ 110.00	\$ (400.00)	\$ 40.00

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS - IRON BUTTERFLIES

IB 9:30 W30 – Estable y consistente

Con 4 de 5 sesiones en verde, esta configuración cerró la semana con una ganancia de **\$510.00**. Muestra una evolución sólida, manteniéndose firme como una de las más confiables dentro del horario de apertura. Su control de riesgo sigue funcionando de forma efectiva.

IB 9:30 W50 – La estrategia líder no afloja

Otra semana de excelentes resultados con una ganancia de **\$970.00**, manteniéndose como la estrategia estrella del sistema. Su performance consistente confirma que la estructura amplia con alas extendidas sigue siendo la más rentable del año. Ideal para quienes priorizan estabilidad y retorno.

IB 9:40 W40 – En plena recuperación

Logró una ganancia de **\$950.00**, igualando casi a la mejor de la semana. Tras semanas de rendimiento irregular, esta configuración demuestra que sigue teniendo un alto potencial cuando el entorno acompaña. Muy buen momento técnico y estadístico.

IB 10:30 W40 – Cumplió con su rol

Cerró con una ganancia de **\$110.00**, modesta pero positiva. Si bien no brilló, se mantuvo operando con regularidad. Este horario continúa mostrando equilibrio y fiabilidad, con bajo drawdown y aciertos frecuentes.

IB 11:00 W40 – Semana negativa, pero bajo observación

Fue la única estrategia con resultado negativo esta semana **-\$400.00**, producto de cuatro SL consecutivos. Ya venía en revisión y este resultado refuerza la necesidad de seguirla evaluando. La exposición se ha reducido en semanas anteriores para limitar impacto.

IB 11:30 W40 – Resultado discreto pero positivo

Sumó **\$40.00** en la semana. Aunque el monto es menor, logró cerrar en verde gracias a una victoria el jueves. Su TP elevado y SL contenido hacen que tenga potencial de recuperación si se estabiliza en próximas jornadas

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS - IRON CONDORS

A partir de esta semana comenzamos a seguir **dos nuevas configuraciones de Iron Condor**, con el objetivo de seguir profundizando en la diversificación horaria y en el análisis de estructuras con perfiles de riesgo más ajustados.

Estas nuevas estrategias se diferencian principalmente por su configuración de **delta 15 y spread de 10 puntos**, lo que les otorga un perfil más direccional pero con menor exposición.

◆ IC 9:30 d15 w10

Una estrategia que combina la fuerza estadística de la apertura con strikes más cercanos al precio (d15) y menor amplitud. Ideal para capturar movimientos controlados en la primera media hora.

◆ IC 10:30 d15 w10

Ubicada en un horario que ya ha demostrado alta efectividad (10:30), esta nueva variante busca validar si el enfoque más agresivo en delta también puede tener sentido con spreads ajustados.

Ambas configuraciones ya comenzaron a ser evaluadas con datos reales esta semana, y serán incorporadas a los reportes semanales con su propio análisis de rendimiento. Esta ampliación forma parte de la evolución constante del sistema: **más datos, más precisión, y mayor capacidad de adaptación al entorno de mercado.**

A continuación los resultados de los Iron Condors:

Día	9:30 d10 w20	9:30 d15 w10	10:30 d10 w20	10:30 d15 w10
Mon, 06/09/2025	✓	✓	✓	✓
Tue, 06/10/2025	✓	✓	✓	✓
Wed, 06/11/2025	✓	✓	✓	✓
Thu, 06/12/2025	✗	✓	✓	✓
Fri, 06/13/2025	✓	✓	✓	✗
GANANCIA/PERDIDA	\$ 330.00	\$ 200.00	\$ 500.00	\$ (10.00)

IC 9:30 d10 w20 – Muy sólida en apertura

Con 4 días ganadores sobre 5, esta configuración entregó una ganancia de **\$330.00**. Se mantiene como una de las variantes más estables, con buena lectura del movimiento inicial del SPX. Ideal para quienes priorizan control desde temprano.

IC 9:30 d15 w10 – Estable y controlada

Otra estrategia de apertura que mostró buen rendimiento. Cerró con **\$200.00**, sin grandes sobresaltos. Aunque su perfil es más conservador por el spread más angosto (w10), sigue demostrando utilidad como complemento defensivo.

IC 10:30 d10 w20 – La más rentable de la semana

Con una excelente ganancia de **\$500.00**, fue la mejor de las cuatro Iron Condors. Demuestra que el horario de 10:30 sigue siendo eficaz para capturar movimientos controlados. Esta versión con spread amplio y delta 10 mantiene un perfil balanceado y robusto.

IC 10:30 d15 w10 – Alineada, pero con un pequeño tropiezo

A pesar de cerrar en **-\$10.00**, estuvo muy cerca del equilibrio, con 4 de 5 días ganadores. Un SL el viernes impidió el cierre positivo, pero su consistencia a lo largo de la semana la deja bien posicionada para seguir en observación con confianza.

CONCLUSION

La semana 24 dejó un claro mensaje: cuando el sistema encuentra un entorno favorable, las estrategias que priorizan estructura y datos responden con fuerza.

Cinco de las seis estrategias Iron Butterfly cerraron en positivo, con un rendimiento destacado de las configuraciones de apertura. En particular, **9:30 w50** y **9:40 w40** brillaron una vez más, acumulando **\$970.00** y **\$950.00** respectivamente. Por su parte, **9:30 w30** aportó **\$510.00**, consolidándose como una de las más estables del año. En contraste, **11:00 w40** sigue bajo revisión tras una semana complicada con **-\$400.00**.

En el frente de las **Iron Condor**, el rendimiento fue sólido en las cuatro configuraciones activas. Tanto las estrategias de 9:30 como de 10:30, con spreads w20 y w10, sumaron resultados positivos. Destacó especialmente **10:30 d10 w20**, con una ganancia semanal de **\$500.00** y consistencia en casi todas las sesiones.

Balance combinado total (IB + IC): +\$3200.00

Una semana altamente positiva, con validación de estrategias líderes y señales alentadoras incluso entre configuraciones recientemente ajustadas. Además, comenzamos a monitorear dos nuevas variantes de Iron Condor (d15 w10), ampliando aún más el espectro del sistema y reforzando nuestro compromiso con la evolución constante.

En resumen: cuando el mercado ofrece oportunidades, nuestro enfoque estructurado y estadístico demuestra su valor

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 25 [06/16/2025 – 06/21/2025]

El algoritmo ya ajustó los niveles de Take Profit (TP) y Stop Loss (SL) de cara a una nueva semana operativa. Las estrategias que vienen mostrando mayor solidez mantienen sus configuraciones sin cambios relevantes, mientras que aquellas con menor rendimiento fueron optimizadas para proteger el capital.

Estrategia	TP	SL
IB 09:30 30W	\$ 160.00	\$ (150.00)
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	\$ (90.00)
IB 11:30 40W	\$ 320.00	\$ (70.00)
IC 09:30 d10 w20	\$ 100.00	\$ (130.00)
IC 09:30 d15 w10	\$ 60.00	\$ (110.00)
IC 10:30 d10 w20	\$ 100.00	\$ (70.00)
IC 10:30 d15 w10	\$ 40.00	\$ (90.00)

Iron Butterflies

- **IB 9:30 W50** y **IB 9:40 W40** siguen liderando el sistema con TPs elevados de \$320 y SLs amplios, pero acordes a su alto rendimiento histórico. Estas configuraciones siguen siendo nuestras principales apuestas.
- **IB 9:30 W30** ajusta a un perfil más equilibrado (TP \$160 / SL -\$150), buscando mantener estabilidad sin asumir riesgos excesivos.
- **IB 10:30 W40** continúa con su esquema habitual (TP \$100 / SL -\$290), ideal para quienes priorizan consistencia.
- **IB 11:00 W40** y **IB 11:30 W40** presentan estructuras de alto TP (\$120 y \$320) pero con señales de bajo rendimiento en semanas recientes. A pesar de los SLs reducidos (-\$90 y -\$70), **el sistema recomienda pausar estas estrategias por el momento**, al menos hasta que los datos confirmen una mejora sostenida.

Iron Condors

- **IC 10:30 d10 w20** se consolida como la más sólida del grupo, manteniendo TP \$100 y SL contenido en -\$70.
- **IC 9:30 d10 w20** y **IC 9:30 d15 w10** ajustan sus márgenes para mayor control (TP \$100 y \$60, con SLs de -\$130 y -\$110).
- **IC 10:30 d15 w10** se mantiene en modo conservador (TP \$40 / SL -\$90), acompañando con menor exposición.

Atención:

Las configuraciones después de las **11:00 (IB 11:00 y 11:30)** han mostrado resultados muy débiles en las

últimas semanas. A pesar de los ajustes automáticos, **se sugiere pausarlas de forma preventiva**, enfocando la operativa en los horarios más consistentes y rentables.

NOTA FINAL

La semana 24 dejó un mensaje claro: cuando el sistema funciona en conjunto, el resultado habla por sí solo.

De las 10 estrategias operativas, **9 cerraron en positivo**, mostrando un comportamiento altamente eficiente en un entorno de mercado con oportunidades claras y moderada volatilidad.

El **balance total combinado (IB + IC)** fue de **+\$3,200.00**, destacándose especialmente las estrategias **IB 9:30 W50, IB 9:40 W40 e IC 10:30 d10 w20**, que volvieron a confirmar por qué son pilares clave del sistema.

Incluso aquellas configuraciones que venían con semanas más débiles lograron revertir parcialmente su desempeño, gracias a una estructura que aprende y se adapta.

Por otro lado, **la única estrategia negativa fue IB 11:00 W40**, lo cual refuerza lo que venimos observando: los horarios posteriores a las 11:00 presentan una mayor vulnerabilidad estadística. El sistema ya lo ha identificado y respondió con ajustes en los SLs, además de una recomendación de pausa temporal para reducir exposición.

Esta semana es un recordatorio de por qué **operamos con datos y estructura, no con intuición**. No se trata de adivinar cuándo vendrán las buenas rachas, sino de estar posicionados para aprovecharlas cuando llegan, y protegidos cuando no.

Resumen general

- 6 estrategias Iron Butterfly con balance positivo en conjunto.
- 4 estrategias Iron Condor también en verde, sumando consistencia y cobertura.
- Sistema diversificado, adaptativo y guiado 100% por estadísticas.

Seguimos adelante, semana a semana.

Con lógica, con foco, y siempre con datos.

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.