

Bienvenidos al Boletín Semanal de Análítica SPX

SPX SEMANA 27 [06/30/2025 – 07/04/2025]

SEMANA CORTA PERO INMEJORABLE

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 26 cerró con un resultado sólido y alentador, demostrando nuevamente la importancia de operar con estructura y diversificación.

Con solo cuatro días operativos debido al feriado del viernes 4 de julio, el sistema supo capitalizar bien las oportunidades disponibles, especialmente en las configuraciones de apertura y media mañana.

Las **Iron Butterfly** sumaron un total de **+\$1,410.00**, con rendimientos destacados de IB 11:00 W40 (+\$570.00), IB 10:30 W40 (+\$400.00) y la consistente IB 9:30 W30 (+\$330.00). Aunque algunas estrategias aún muestran altibajos —como IB 9:30 W50 y IB 9:40 W40— el balance general fue netamente positivo.

Por su parte, las **Iron Condor** mantuvieron su perfil de estabilidad, cerrando con **+\$610.00** de ganancia conjunta. Todas las variantes aportaron valor, destacándose especialmente IC 9:30 D10 W20 y IC 9:30 D15 W10 con resultados claros y consistentes a lo largo de la semana.

En conjunto, el **balance combinado IB + IC** fue de **+\$2,020.00**, reflejando que la disciplina en la gestión de riesgo y la adaptación de parámetros sigue siendo clave para navegar semanas con jornadas mixtas y festivos intercalados.

Una muestra más de que no se trata de adivinar, sino de mantenernos presentes, diversificados y fieles a la estadística.

A continuación, el detalle del comportamiento semanal de las 10 estrategias:

Día	IB 9:30 W30	IB 9:30 W50	IB 9:40 W40	IB 10:30 W40	IB 11:00 W40	IB 11:30 W40	IC 9:30 D10 W20	IC 9:30 D15 W10	IC 10:30 D10 W20	IC 10:30 D15 W10
6/30/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
7/01/2025	✓	✓	✓	✓	✗	✗	✓	✓	✓	✓
7/02/2025	✓	✗	✗	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
7/03/2025	✗	✗	✗	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
7/04/2025	FERIADO	FERIADO	FERIADO	FERIADO	FERIADO	FERIADO	FERIADO	FERIADO	FERIADO	FERIADO
Total	\$330	\$20	-\$20	\$400	\$570	\$110	\$230	\$160	\$60	\$160

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS INDIVIDUALES

IRON BUTTERFLIES

- Las Iron Butterflies mostraron un desempeño equilibrado, confirmando que la diversificación por horarios y estructura es uno de los mayores activos del sistema. La apertura volvió a dar señales de fortaleza, mientras que las estrategias de media mañana aportaron estabilidad.
- IB 9:30 W30: Cerró con +\$330.00, destacándose por capitalizar bien los movimientos iniciales de la sesión. Su solidez la mantiene como una base confiable para cubrir la apertura.
- IB 9:30 W50: Aportó +\$20.00, manteniéndose casi neutra, pero demostrando que su relación riesgo/beneficio sigue alineada con su robustez histórica.
- IB 9:40 W40: Resultado muy cercano al equilibrio, con -\$20.00, mostrando control y consistencia a pesar de algunas salidas anticipadas.
- IB 10:30 W40: Excelente rendimiento de +\$400.00, consolidando su lugar como una de las configuraciones más estables. Confirma por qué se sigue priorizando cuando la apertura se vuelve incierta.
- B 11:00 W40: Sorprendió con +\$570.00, aportando un impulso importante al balance semanal. Refleja que su perfil de riesgo ajustado puede traducirse en oportunidades valiosas cuando el entorno lo permite.
- IB 11:30 W40: Sumó +\$110.00, extendiendo su tendencia positiva y reafirmando su aporte como estrategia complementaria en los tramos finales de la mañana.

IRON CONDORS

- Las Iron Condors complementaron el desempeño general con resultados consistentes en todas sus variantes. Este bloque sigue demostrando que, incluso en días menos estructurados, su diseño amortigua pérdidas y contribuye de forma estable.
- IC 9:30 d10 w20: Cerró con +\$230.00, manteniendo su perfil firme en horarios de apertura cuando se detectan rangos definidos.
- IC 9:30 d15 w10: Aportó +\$160.00, validando el valor de esta variante con spreads ajustados y deltas amplios para escenarios intermedios.
- IC 10:30 d10 w20: Sumó +\$60.00, resultado alineado a su función de equilibrio, con bajo riesgo y exposición controlada.
- IC 10:30 d15 w10: Cerró con +\$160.00, confirmando que esta estructura sigue siendo una pieza útil para diversificar horarios sin sacrificar consistencia.

CONCLUSION

La **semana 27** cerró con un balance combinado **positivo de \$2,020**, un resultado que vuelve a confirmar el valor de operar con estructura, datos y diversificación.

El desempeño destacado de varias estrategias Iron Butterfly, especialmente **11:00 W40 (+\$570)** y **10:30 W40 (+\$400)**, sumado a la fortaleza de las Iron Condors, ayudó a sostener la curva ascendente, incluso con una sesión de viernes ausente por feriado.

Aunque algunas configuraciones mantuvieron altibajos —como 9:40 W40 con un leve -\$20— la visión de conjunto demuestra que tener múltiples horarios y spreads funcionando al mismo tiempo permite balancear los resultados semana a semana.

Además, es importante resaltar la robustez de las Iron Condors, que cerraron en verde en su totalidad, aportando **\$610** al resultado global y recordando que su función principal es amortiguar la volatilidad de las mariposas más expuestas.

No se trata de acertar todos los días, sino de estar presentes, gestionar el riesgo y dejar que la estadística haga su trabajo. La consistencia viene de la suma de semanas como esta: positivas, equilibradas y con ajustes activos para proteger el capital cuando sea necesario.

Seguimos adelante, con la misma lógica: disciplina, datos y confianza en un proceso que prioriza la rentabilidad a largo plazo.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 27 [07/07/2025 – 07/11/2025]

El sistema recalibró automáticamente los niveles de **Take Profit (TP)** y **Stop Loss (SL)** para cada estrategia, basándose en el rendimiento reciente y en las condiciones actuales del mercado. Estos ajustes buscan mantener la coherencia entre oportunidad y protección de capital.

Iron Butterfly

- **IB 9:30 W50 y IB 9:40 W40** mantienen su perfil de alto potencial con **TP de \$320.00** y **SL amplios**, reflejando su fortaleza estadística, incluso tras semanas mixtas.
- **IB 9:30 W30** vuelve a mostrar un enfoque más conservador: su TP se ajusta a **\$80.00** mientras que el SL se sitúa en **-\$210.00**, reforzando la protección.
- **IB 10:30 W40 y 11:00 W40** suben su TP a **\$280.00** manteniendo SL consistentes (**-\$330.00** y **-\$270.00**), confirmando su valor como configuraciones equilibradas.
- **IB 11:30 W40** sostiene un **TP alto (\$320.00)** con SL de **-\$250.00**, lo que confirma su perfil de exposición más agresiva, pero siempre bajo revisión.

Iron Condor

- Las estrategias tradicionales —**IC 9:30 d10 w20 y IC 10:30 d10 w20**— mantienen su **TP de \$100.00**, con SL ajustados (**-\$130.00 y -\$90.00**) para absorber posibles movimientos bruscos.

- Las variantes **d15 w10** se alinean como amortiguadoras:
 - **IC 9:30 d15 w10** sostiene un **TP de \$40.00** con **SL de -\$110.00**, perfil conservador pero flexible.
 - **IC 10:30 d15 w10** mantiene **TP \$40.00 / SL -\$70.00**, confirmando su función como contrapeso dentro del bloque de IC.

Estos parámetros son prueba de la adaptabilidad del sistema: cada configuración se ajusta dinámicamente según su rendimiento y entorno, priorizando el equilibrio entre rendimiento y preservación del capital.

Tabla General:

Estrategia	TP	SL
IB 09:30 30W	80	-290
IB 09:30 50W	320	-310
IB 09:40 40W	320	-330
IB 10:30 40W	100	-330
IB 11:00 40W	280	-270
IB 11:30 40W	320	-150
IC 09:30 d10 w20	100	-290
IC 09:30 d15 w10	40	-290
IC 10:30 d10 w20	100	-70
IC 10:30 d15 w10	40	-70

NOTA FINAL

La **Semana 27** cerró con un **balance positivo de +\$2,020.00**, mostrando cómo un sistema basado en datos y diversificación responde tras semanas de ajustes.

Las **Iron Butterfly** aportaron la mayor parte del resultado con **\$1,410.00**, gracias a la excelente actuación de **IB 11:00 W40** (+\$570.00) y **IB 10:30 W40** (+\$400.00), que confirmaron su rol de soporte clave en horarios de media mañana. También **IB 9:30 W30** y **W50** defendieron bien la apertura, sumando estabilidad.

Del lado de las **Iron Condor**, las cuatro configuraciones cerraron en verde y reforzaron la cobertura del portafolio. En particular, **IC 9:30 d10 w20** lideró con +\$230.00, mientras que las variantes **d15 w10** continuaron mostrando su valor como amortiguador defensivo.

Este resultado demuestra una vez más que no se trata de evitar pérdidas puntuales, sino de sostener la consistencia global. La clave está en seguir recalibrando TP/SL cuando el mercado cambia y dejar que la lógica estadística haga su trabajo.

✅ Resumen General

- 5 de 6 estrategias IB en positivo, liderando la recuperación.
- Las 4 IC cerraron con balance verde, aportando defensa estable.
- Ajustes activos en curso para proteger capital y capturar nuevas oportunidades.

Seguimos avanzando, con disciplina, estructura y visión de largo plazo.

Nos vemos en el próximo boletín.

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.