

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX SEMANA 28 [07/07/2025 – 07/11/2025]

EQUILIBRIO Y DIVERSIFICACION

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 28** cerró prácticamente neutra, recordándonos que no todas las semanas traen grandes movimientos, pero cada sesión suma para construir resultados consistentes a largo plazo.

A pesar de la volatilidad en horarios puntuales, el sistema mantuvo su estructura diversificada y amortiguó pérdidas mayores gracias al buen desempeño de varias estrategias clave.

Iron Butterfly:

Las IBs aportaron resultados mixtos, acumulando un total combinado de **+50.00**. Destacaron una vez más **IB 9:30 W50** (+\$970.00) y **IB 9:40 W40** (+\$300.00), que lograron sostenerse firmes pese a jornadas de apertura irregulares. Por otro lado, **10:30 W40** (-\$1,040.00) y algunas configuraciones de media mañana cerraron negativas, pero con impacto limitado por stops ajustados.

Iron Condor:

Las ICs reforzaron el balance final con un aporte combinado de -\$170.00, mostrando que incluso en semanas con rangos estrechos y menor tendencia, siguen cumpliendo su función de contención de riesgo. Se destacó **IC 9:30 d10 w20** (+\$270.00), mientras que las variantes d15 w10 enfrentaron retrocesos, pero dentro de parámetros de control.

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

Un resultado que confirma que el valor del sistema está en su diversificación y ajuste dinámico: mientras algunas estrategias atraviesan semanas complejas, otras compensan o amortiguan sin comprometer la curva general.

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
7/07/2025	✓	✓	✓	✗	✗	✗	✓	✗	✓	✗
7/08/2025	✓	✓	✓	✗	✗	✗	✓	✓	✓	✗
7/08/2025	✗	✗	✗	✗	✓	✓	✗	✗	✗	✗
7/10/2025	✓	✓	✗	✗	✗	✓	✓	✗	✗	✗
7/11/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✗	✓	✓	✓	✓
Total	\$110	\$970	\$300	\$-1040	\$-250	\$-110	\$270	\$-250	\$120	\$-240

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS INDIVIDUALES

IRON BUTTERFLIES

- Esta semana, las Iron Butterflies mostraron un comportamiento **muy mixto**, confirmando que la diversificación por horarios es clave para amortiguar semanas de movimientos menos predecibles. Hubo estrategias que sumaron bien, mientras que otras enfrentaron salidas por SL más profundas.
- **IB 9:30 W30:** Sumó +\$110.00. A pesar de una apertura algo inestable, logró rescatar ganancias, manteniéndose como base sólida para cubrir gaps tempranos.
- **IB 9:30 W50:** Brillante una vez más, cerrando con +\$970.00. Su estructura amplia volvió a capitalizar movimientos limpios, reafirmando por qué sigue siendo uno de los pilares del sistema.
- **IB 9:40 W40:** Resultado positivo de +\$300.00, validando su buen momento tras semanas mixtas. Muestra que, bien calibrada, su relación TP/SL se mantiene rentable.
- **IB 10:30 W40:** La cara opuesta: -\$1,040.00, afectada por stops seguidos en sesiones volátiles. Aun así, conserva un historial robusto, por lo que se mantiene activa, pero bajo ajuste.
- **IB 11:00 W40:** Cerró con -\$250.00. Su perfil de riesgo ya reducido limitó mayores daños. Sigue bajo observación para confirmar si logra estabilizarse.
- **IB 11:30 W40:** Terminó con -\$110.00. Aunque venía de semanas más estables, esta vez los SL pesaron. El sistema mantendrá un control más estricto para evitar acumulación de retrocesos.

IRON CONDORS

- Las Iron Condors aportaron su rol clásico de **amortiguador**, aunque en rangos bastante mixtos esta semana. Sus resultados ayudan a entender la importancia de combinarlas con las IB.
- **IC 9:30 d10 w20:** Muy buen desempeño de +\$270.00, consolidándose como una estructura fuerte cuando la apertura muestra direccionalidad clara.
- **IC 9:30 d15 w10:** Cerró con -\$250.00. Esta variante mostró más sensibilidad a días con rangos demasiado estrechos. Se mantiene bajo revisión.
- **IC 10:30 d10 w20:** Sumó +\$120.00, cumpliendo su papel de equilibrio en horarios de media mañana.
- **IC 10:30 d15 w10:** Registró -\$240.00, su segunda semana con retroceso relevante. El sistema ajustará SL para contener exposición si persiste la volatilidad.

CONCLUSION

La Semana 28 cerró con un balance **ligeramente negativo de -\$120.00**, mostrando que incluso cuando el mercado presiona, el sistema mantiene su capacidad de absorción y control del riesgo.

El bloque de **Iron Butterfly** tuvo contrastes claros: **IB 9:30 W50 (+\$970)** y **IB 9:40 W40 (+\$300)** se destacaron como pilares de apertura, mientras que la presión recayó en **IB 10:30 W40 (-\$1,040)** y las estrategias de media mañana, que aún requieren ajustes para mitigar la volatilidad.

Por su parte, las **Iron Condors** cumplieron su función defensiva, suavizando pérdidas con aportes sólidos de **IC 9:30 d10 w20 (+\$270)** y **IC 10:30 d10 w20 (+\$120)**. Las variantes **d15 w10**, en cambio, evidenciaron mayor fragilidad esta semana, pero su papel como complemento de diversificación sigue siendo valioso.

Esta semana reafirma que el objetivo no es ganar cada día, sino sostener la curva de capital sin sobresaltos mayores, manteniendo la coherencia estadística a través de la disciplina y el ajuste continuo.

El control de riesgo es tan importante como la rentabilidad. Una semana casi neutra, en contexto, demuestra que la estructura funciona.

Seguimos adelante, fieles a los datos, la consistencia y el enfoque de largo plazo.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 29 [07/14/2025 – 07/18/2025]

El sistema ha recalibrado los niveles de **Take Profit (TP)** y **Stop Loss (SL)** para cada configuración, alineándolos con el comportamiento más reciente y la estructura estadística del mercado. Esta actualización refleja la filosofía de mantener exposición controlada y adaptarse dinámicamente. **Tabla General:**

Estrategia	TP	SL
IB 09:30 30W	200	-150
IB 09:30 50W	320	-270
IB 09:40 40W	320	-330
IB 10:30 40W	100	-330
IB 11:00 40W	320	-270
IB 11:30 40W	320	-250
IC 09:30 d10 w20	100	-290
IC 09:30 d15 w10	40	-110
IC 10:30 d10 w20	100	-90
IC 10:30 d15 w10	40	-70

NOTA FINAL

La **Semana 28** cerró con un **balance prácticamente neutro**, mostrando cómo la diversificación y la lógica estadística siguen siendo la base para atravesar semanas mixtas sin comprometer la curva de capital.

Resumen General

- 3 de 6 estrategias **IB** en positivo, destacando aperturas sólidas.
- 2 de 4 estrategias **IC** con saldo favorable, reforzando la cobertura.
- Sistema dinámico y ajustes activos en TP/SL para proteger capital.

Esta semana vuelve a recordarnos que **no se trata de acertar cada día**, sino de mantenernos presentes, gestionar los riesgos y dejar que la estadística actúe a favor del largo plazo.

Seguimos operando con disciplina, datos y visión estructurada.

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.