

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX SEMANA 33 [08/11/2025 – 08/15/2025]

SEMANA DESAFIANTE Y DEFENSA ACTIVA

Bienvenidos a una nueva edición del boletín semanal, donde seguimos monitoreando el rendimiento de nuestras estrategias neutrales sobre el índice SPX. Como siempre, nos guiamos exclusivamente por los datos, la estadística y una ejecución disciplinada —sin emociones ni intuiciones.

RESUMEN SEMANAL

La **Semana 33** estuvo marcada por un escenario complejo, donde las **Iron Butterflies** acumularon pérdidas relevantes, mientras que las **Iron Condors** cumplieron su función defensiva y lograron sostener el balance con un leve resultado positivo.

En las **IBs**, el saldo total fue de **-\$1,450.00**, destacando negativamente las aperturas de **9:30 W50** (**-\$760.00**) y **9:30 W30** (**-\$420.00**), que arrastraron buena parte del rendimiento semanal. Solo **9:40 W40** (**+\$120.00**) logró mantenerse en verde, mostrando que aún en semanas adversas se pueden rescatar aportes selectivos.

Por el lado de las **ICs**, el resultado combinado fue de **+\$40.00**, con tres de las cuatro configuraciones en positivo, aunque con ganancias muy modestas. La excepción fue **10:30 d10 w20** (**-\$100.00**), que no logró sostenerse ante stops tempranos.

El cierre semanal confirma que la diversificación sigue siendo clave: mientras un grupo de estrategias atraviesa retrocesos, otras logran contener el daño y asegurar la consistencia global.

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
8/11/2025	✓	✓	✓	✓	✗	✗	✓	✓	✓	✓
8/12/2025	✗	✗	✗	✓	✗	✗	✗	✓	✗	✗
8/13/2025	✗	✗	✗	✓	✓	✓	✗	✓	✗	✓
8/14/2025	✗	✗	✗	✗	✗	✓	✗	✗	✗	✗
8/15/2025	✗	✗	✗	✓	✓	✗	✓	✓	✗	✓
Total	-\$420	-\$760	\$120	-\$10	-\$230	\$-150	\$50	\$50	-\$100	\$40

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS INDIVIDUALES

IRON BUTTERFLIES

Las Iron Butterflies atravesaron una **semana desafiante**, con un balance neto negativo que reflejó la presión de los mercados en horarios de apertura y media mañana. La diversidad horaria permitió rescatar algunos aportes puntuales, pero no logró revertir la tendencia general.

- **IB 9:30 W30:** Cerró con **-\$420.00**, mostrando vulnerabilidad en aperturas erráticas.
- **IB 9:30 W50:** La más afectada de la semana con **-\$760.00**, acumulando varias salidas por SL en sesiones consecutivas.
- **IB 9:40 W40:** Única en positivo con **+\$120.00**, confirmando que mantiene potencial aún en semanas adversas.
- **IB 10:30 W40:** Terminó prácticamente neutra con **-\$10.00**, equilibrando stops con algunos aciertos.
- **IB 11:00 W40:** Retrocedió **-\$230.00**, afectada por señales inconsistentes en media mañana.
- **IB 11:30 W40:** Finalizó en **-\$150.00**, acumulando stops en sesiones de baja direccionalidad.

En conjunto, las IBs cerraron con un saldo de **-\$1,450.00**, reforzando la importancia de ajustes continuos en niveles de SL y en la gestión de horarios.

IRON CONDORS

Las Iron Condors ofrecieron un desempeño **más estable**, cumpliendo su rol defensivo y cerrando en terreno positivo pese a la volatilidad intermedia. Aunque las ganancias fueron modestas, sirvieron para **contener el daño global del portafolio**.

- **IC 9:30 d10 w20:** Aportó **+\$50.00**, mostrando consistencia en aperturas.
- **IC 9:30 d15 w10:** También con **+\$50.00**, consolidando estabilidad en rangos estrechos.
- **IC 10:30 d10 w20:** Retroceso de **-\$100.00**, afectado por stops rápidos en media mañana.
- **IC 10:30 d15 w10:** Sumó **+\$40.00**, validando su función de contención.

En conjunto, las ICs cerraron con **+\$40.00**, confirmando que su papel como amortiguador sigue vigente incluso en semanas de retrocesos de las IBs.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 34 [08/18/2025 – 08/22/2025]

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**, priorizar la gestión del riesgo, y adaptarse dinámicamente según las condiciones del SPX.

Tabla General:

Estrategia	TP	SL
IB 09:30 30W	\$180.00	\$(130.00)
IB 09:30 50W	\$320.00	\$(190.00)
IB 09:40 40W	\$320.00	\$(50.00)
IB 10:30 40W	\$240.00	\$(70.00)
IB 11:00 40W	\$320.00	\$(130.00)
IB 11:30 40W	\$300.00	\$(250.00)
IC 09:30 d10 w20	\$120.00	\$(50.00)
IC 09:30 d15 w10	\$40.00	\$(110.00)
IC 10:30 d10 w20	\$100.00	\$(50.00)
IC 10:30 d15 w10	\$60.00	\$(70.00)

NOTA FINAL

La **Semana 33** cerró con un balance combinado de **-\$1,410.00**, resultado que refleja la dificultad de los últimos días para las **Iron Butterflies**, compensado parcialmente por el aporte defensivo de las **Iron Condors**. Fue una semana desafiante, con múltiples stops en horarios de apertura y media mañana, lo que afectó de manera significativa el rendimiento global.

Aun así, la esencia del sistema permanece clara: **no se trata de evitar semanas negativas**, sino de mantener una estrategia diversificada que, en el largo plazo, amortigüe los retrocesos y capture las oportunidades que ofrece el mercado en escenarios más favorables.

Las **IBs** tuvieron un saldo negativo marcado (-\$1,450.00), liderado por las pérdidas en **9:30 W50 y 9:30 W30**. El único desempeño destacado vino de **9:40 W40 (+\$120.00)**, que mostró resiliencia en jornadas adversas.

Las **ICs**, por su parte, cumplieron su función de equilibrio al cerrar con **+\$40.00**, con tres de cuatro configuraciones en verde. Este pequeño aporte fue suficiente para demostrar que la diversificación sigue protegiendo al portafolio en semanas complicadas.

Resumen General

- Semana negativa para las **IBs**, con pérdidas concentradas en aperturas.
 - **ICs** lograron sostener un leve balance positivo, validando su función defensiva.
 - El sistema mantiene su enfoque de **ajuste dinámico de TP/SL** y disciplina en la ejecución.
 - El valor está en la **consistencia de largo plazo**, no en la volatilidad de una sola semana.
-

Seguimos avanzando con disciplina, visión estadística y enfoque estratégico.

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.