

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX – Semana 43 [10/20/2025 – 10/24/2025]

SEMANA POSITIVA Y TENDENCIA NEUTRAL

Bienvenidos a una nueva edición del Boletín Semanal de Analítica SPX.

Esta semana se caracterizó por un **retorno a la estabilidad y un repunte sólido de rendimiento** tras las pérdidas de la semana anterior.

El SPX operó en rangos más definidos, con menor dispersión intradía y una estructura gamma más equilibrada, lo que favoreció la recuperación de las estrategias neutrales, en especial las **Iron Butterflies**.

RESUMEN SEMANAL

La **Semana 43** cerró con un **balance combinado positivo de +\$1,620.00**, impulsado principalmente por las configuraciones tardías de las **Iron Butterflies (11:30 y 9:40)**.

El contexto de menor volatilidad permitió mayor eficacia en los cierres direccionales, reduciendo stops y mejorando la relación TP/SL promedio.

Las **Iron Condors** acompañaron con resultados estables y consistentes, logrando mantener su función de cobertura con ganancias moderadas.

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 10:30 D10 W20	IC 09:30 D15 W10	IC 10:30 D15 W10
10/13/2025	✗	✗	✗	✓	✓	✓	✗	✓	✗	✗
10/14/2025	✗	✗	✓	✗	✗	✓	✓	✗	✓	✗
10/15/2025	✓	✓	✓	✓	✗	✗	✓	✓	✓	✓
10/16/2025	✗	✗	✗	✓	✓	✓	✗	✓	✗	✓
10/17/2025	✗	✗	✓	✗	✗	✓	✗	✓	✗	✗
Total	\$ -140	\$ -40	\$ 700	\$ -240	\$ 290	\$ 950	\$ 50	\$ 50	\$ 50	\$ -90

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS INDIVIDUALES

IRON BUTTERFLIES

Las Butterflies tuvieron una semana de **excelente recuperación**, liderando el rendimiento con un total de **+\$1,520.00**.

La menor volatilidad implícita y la estabilidad en los rebotes técnicos favorecieron los cierres parciales y los Take Profit programados.

- **IB 9:30 W30 (-\$140)** → Ligera pérdida; aún sensible a la apertura.

- **IB 9:30 W50 (-\$40)** → Casi break-even; buena defensa en martes.
- **IB 9:40 W40 (+\$700)** → Excelente performance; aprovechó los rebotes técnicos del miércoles y viernes.
- **IB 10:30 W40 (-\$240)** → Semana débil, con stops activados por movimientos de media mañana.
- **IB 11:00 W40 (+\$290)** → Recuperación sólida tras una semana previa difícil.
- **IB 11:30 W40 (+\$950)** → Destacada del período; cerró cuatro de cinco días en positivo y alcanzó varios TP consecutivos.

Conclusión:

Las **estructuras de 9:40 y 11:30** consolidan su posición como las más rentables en escenarios neutrales. El sistema logró recomponer la curva general gracias a la sincronización con el rango del SPX y una reducción natural de la gamma negativa.

IRON CONDORS

Las Condors cerraron la semana con un **saldo positivo moderado de +\$60.00**, manteniendo su rol estabilizador.

Las configuraciones de **10:30** siguen mostrando la mejor correlación con los rangos consolidados de media mañana.

- **IC 9:30 d10 w20 (+\$50)** → Consistente; se benefició de menor exposición al movimiento inicial.
- **IC 10:30 d10 w20 (+\$50)** → Cumplió función defensiva, manteniendo ratio positivo.
- **IC 9:30 d15 w10 (+\$50)** → Buena adaptación, resultado estable.
- **IC 10:30 d15 w10 (-\$90)** → Única con cierre negativo; afectada por compresión en el tramo final del viernes.

Conclusión:

Las Condors siguen aportando estabilidad al portafolio general, especialmente en jornadas de rango lateral.

El patrón estadístico confirma que las **10:30** deben seguir siendo preferencia operativa en semanas de consolidación.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 43 [10/20/2025 – 10/25/2025]

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.

Tabla General:

Estrategias	TP	SL
IB 09:30 30W	\$220.00	-\$90.00
IB 09:30 50W	\$320.00	-\$90.00
IB 09:40 40W	\$320.00	-\$130.00
IB 10:30 40W	\$140.00	-\$330.00
IB 11:00 40W	\$280.00	-\$90.00
IB 11:30 40W	\$300.00	-\$250.00
IC 09:30 d10 w20	\$100.00	-\$50.00
IC 10:30 d10 w20	\$40.00	-\$110.00
IC 09:30 d15 w10	\$100.00	-\$50.00
IC 10:30 d15 w10	\$60.00	-\$70.00

NOTA FINAL

La **Semana 43** representa una **recuperación técnica completa**, evidenciando la solidez del sistema en entornos estadísticamente favorables.

El desempeño de las **Butterflies tardías** demostró nuevamente que la disciplina horaria y la consistencia en los parámetros generan resultados sostenibles.

✓ Resumen General:

- **IBs:** +\$1,520.00 (5 de 6 en positivo)
- **ICs:** +\$60.00 (3 de 4 en positivo)
- **Balance total:** +\$1,580.00
- **Estrategia destacada:** IB 11:30 W40 (+\$950.00)
- **Condición de mercado:** Rango definido, volatilidad decreciente.
- **Foco actual:** Consolidación de rentabilidad y mantenimiento de estructura neutral.

💡 Conclusión

El éxito no está en evitar las semanas difíciles, sino en sostener la estructura hasta que las estadísticas vuelvan a nuestro favor.

El sistema demostró resiliencia y consistencia, confirmando que los datos, la disciplina y el control del riesgo son el núcleo de la rentabilidad a largo plazo.