

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX – Semana 45 [11/03/2025 – 11/07/2025]

SEMANA DE AJUSTE TÉCNICO Y VOLATILIDAD

La Semana 45 se caracterizó por una **fase de ajuste técnico**, donde el SPX presentó picos de volatilidad intermitente y movimientos direccionales breves, lo que generó un entorno desafiante para las estrategias neutrales.

A pesar de ello, el sistema mantuvo control de riesgo, ejecución disciplinada y un comportamiento estadísticamente estable, destacando nuevamente la **Iron Butterfly 11:00 W40** como punto de solidez dentro de la estructura semanal.

RESUMEN SEMANAL

La semana finalizó con un **balance total de -\$1,050.00**, reflejando un escenario de volatilidad reactiva y retrocesos técnicos dentro del rango.

Las **Iron Butterflies** cerraron con **-\$810.00**, mientras que las **Iron Condors** aportaron **-\$240.00**, limitando parcialmente la pérdida global.

El sistema mantuvo su curva de capital controlada y sin desviaciones estructurales, en línea con la estadística esperada en semanas de transición.

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	\$ -450	\$ -450	\$ -200	\$ -710	\$ 1150	\$ -150	\$ 50	\$ 50	\$ -250	\$ -90

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS INDIVIDUALES

IRON BUTTERFLIES

Las **Iron Butterflies** atravesaron una semana de ajuste estadístico, marcada por una volatilidad irregular y un rango más impredecible en las primeras horas.

Aun así, la **IB 11:00 W40** volvió a sobresalir como punto de consistencia, con una rentabilidad destacada de **+\$1,150.00**.

- **IB 9:30 W30 (-\$450)** → Penalizada por reversión inmediata tras apertura.

- **IB 9:30 W50 (-\$450)** → Movimientos bruscos impidieron alcanzar zona de beneficio.
- **IB 9:40 W40 (-\$200)** → Semana lateral, sin confirmación direccional.
- **IB 10:30 W40 (-\$710)** → Afectada por ampliación de rango y stops forzados.
- **IB 11:00 W40 (+\$1,150)** → Excelente desempeño, validando su fortaleza en entornos mixtos.
- **IB 11:30 W40 (-\$150)** → Resultado neutro; dos aciertos sobre cinco días.

Total IB: -\$810.00

Conclusión:

Las Butterflies tempranas siguen siendo más sensibles a picos direccionales iniciales, mientras que las estructuras tardías mantienen una ventaja estadística clara.

La consistencia de la **IB 11:00 W40** reafirma su rol como ancla del sistema.

IRON CONDORS

Las **Iron Condors** tuvieron una semana de **rendimiento estable dentro de la volatilidad**, cerrando con **-\$240.00**.

Las configuraciones de **10:30** continuaron demostrando mayor resiliencia frente a los cambios de tendencia intradía.

- **IC 9:30 d10 w20 (+\$50)** → Ganancia leve; cumplió función de amortiguación.
- **IC 10:30 d10 w20 (+\$50)** → Consistente y sin stops; mantuvo control del rango.
- **IC 9:30 d15 w10 (-\$250)** → Penalizada por movimientos direccionales del jueves.
- **IC 10:30 d15 w10 (-\$90)** → Pérdida moderada; semana irregular en volatilidad.

Total IC: -\$240.00

Conclusión:

Las Condors cumplieron su función de estabilización general, reduciendo el impacto de las pérdidas en las Butterflies tempranas.

Las configuraciones **10:30** se mantienen como preferencia en semanas de compresión gamma o dirección incierta.

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 46 [11/10/2025 – 11/14/2025]

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	\$240.00	-\$90.00
IB 09:30 50W	\$320.00	-\$190.00
IB 09:40 40W	\$320.00	-\$130.00
IB 10:30 40W	\$220.00	-\$50.00
IB 11:00 40W	\$320.00	-\$130.00
IB 11:30 40W	\$300.00	-\$250.00
IC 09:30 d10 w20	\$100.00	-\$50.00
IC 10:30 d10 w20	\$40.00	-\$130.00
IC 09:30 d15 w10	\$100.00	-\$50.00
IC 10:30 d15 w10	\$60.00	-\$70.00

NOTA FINAL

La Semana 45 sirvió como fase de ajuste y reacomodo, manteniendo control total de riesgo y estructura operativa intacta.

A pesar del retroceso, el sistema conserva consistencia y disciplina, preservando la curva general sin impactos significativos.

Resumen General:

- **IBs:** -\$810.00 (1 de 6 positivas)
- **ICs:** -\$240.00 (2 de 4 positivas)
- **Balance total:** -\$1,050.00
- **Estrategia destacada:** IB 11:00 W40 (+\$1,150.00)
- **Condición de mercado:** Volatilidad reactiva, dispersión gamma.
- **Foco actual:** Preservar consistencia y esperar normalización del rango.

Conclusión

En semanas de ajuste, el valor está en la disciplina.

El sistema continúa sólido, con métricas estables y sin desvíos de riesgo, preparado para retomar la senda estadística cuando el mercado recupere su estructura de equilibrio.

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.