

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SPX – Semana 49 [12/01/2025 – 12/05/2025]

SEMANA ESTABLE, CON LA 9:40 Y 11:30 MARCANDO FORTALEZA

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

La Semana 49 mostró mayor estabilidad operativa, rangos más coherentes y un entorno menos agresivo que las semanas previas.

A pesar de movimientos direccionales puntuales, el mercado ofreció secuencias más limpias y mejores oportunidades de salida, especialmente para las estrategias de Iron Butterflies.

El sistema mantuvo disciplina y coherencia con sus parámetros, registrando una semana controlada en términos de riesgo y con señales positivas en dos horarios clave.

RESUMEN SEMANAL

La semana finalizó con un balance total de **-\$380.00**, representando una mejora significativa respecto a ciclos anteriores de alta volatilidad.

Las **Iron Butterflies** cerraron con un resultado muy leve de **-\$170.00**, destacando el rendimiento sólido de:

- **9:40 W40 (+\$310)**
- **11:30 W40 (+\$400)**

Ambas configuraciones mostraron buena lectura del rango y mejor reacción ante los retrocesos.

Las **Iron Condors**, por su parte, terminaron la semana con **-\$210.00**, afectadas por movimientos bidireccionales con poco rango aprovechable. En términos generales, fue una semana más ordenada, con señales claras de estabilización.

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 9:30 d15 w10	IC 10:30 d15 w10
12/01/2025	✗	✗	✗	✗	✓	✓	✗	✓	✗	✗
12/02/2025	✗	✗	✓	✗	✗	✗	✓	✗	✗	✗
12/03/2025	✗	✗	✓	✗	✗	✗	✓	✓	✓	✗
12/04/2025	✗	✗	✗	✓	✗	✓	✗	✓	✗	✓
12/05/2025	✗	✗	✗	✗	✗	✓	✗	✗	✗	✗
Total	\$ -250	\$ -450	\$ 310	\$ 20	\$ -200	\$400	\$50	\$ -100	\$ -60	\$100

ANÁLISIS DE ESTRATEGIAS INDIVIDUALES

IRON BUTTERFLIES

Las Iron Butterflies tuvieron una semana notablemente más estable, impulsadas por dos ventanas con comportamiento destacado: **9:40 W40** y **11:30 W40**.

Comportamiento por estrategia:

- **IB 9:30 W30 (−\$250)**: Baja estabilidad; rupturas tempranas.
- **IB 9:30 W50 (−\$450)**: Movimientos iniciales agresivos afectaron el spread.
- **IB 9:40 W40 (+\$310)**: Excelente semana; capturó retrocesos limpios martes y miércoles.
- **IB 10:30 W40 (+\$20)**: Ligeramente positiva; comportamiento neutro.
- **IB 11:00 W40 (−\$200)**: Direccionalidad sin retrocesos afectó la ventana.
- **IB 11:30 W40 (+\$400)**: Muy buen desempeño; cierres sólidos lunes y viernes.

Conclusión IB

El rendimiento global fue estable, con recuperación clara en las ventanas de **9:40** y **11:30**, que aportaron casi toda la estabilidad semanal.

El resultado total de **−\$170** refleja una semana contenida y bien gestionada.

IRON CONDORS

Las Iron Condors continuaron enfrentando rangos estrechos y movimientos bruscos intradía.

Aun así, algunas ventanas tuvieron momentos de buena lectura.

Resultados por estrategia:

- **IC 9:30 d10 w20 (+\$50)**: Buen desempeño en sesiones con retesteos.
- **IC 10:30 d10 w20 (−\$100)**: Afectada por falta de continuidad del rango.
- **IC 9:30 d15 w10 (−\$60)**: Semana con poco espacio en la zona media.
- **IC 10:30 d15 w10 (−\$100)**: Vulnerable a cambios bruscos de dirección.

Conclusión IC

Semana difícil para las Condors, que dependen más de rangos amplios y estables.

El resultado total fue **−\$210.00**, dentro de lo esperable para este tipo de entorno.

MAPAS DE CALOR

9:40 IB W40 – 11/07/2025

\$	40	60	80	100	120	140	160	180	200	220	240	260	280	300	320
-50	10	40	130	400	800	1010	1180	1540	1650	1990	1750	1740	1690	1950	1840
-70	210	390	40	270	730	980	1190	1610	1760	2160	1940	1970	1960	2280	2210
-90	130	420	-90	490	780	1070	1570	2070	2280	2760	2580	2670	2720	3120	3110
-110	-20	230	-20	580	1180	1530	2110	2690	2960	3520	3380	3530	3640	4120	4170
-130	-130	80	250	370	990	1610	2230	2850	3140	3740	3600	3770	3900	4420	4490
-150	-200	-30	-440	200	640	1480	1810	2430	2700	3300	3120	3270	3380	3900	3950
-170	-230	-100	-590	76	730	1390	1720	2360	2630	3250	3050	3200	2860	3380	3410
-190	-450	380	-970	-310	350	1010	1320	1960	2210	2830	2590	2720	2340	2860	2870
-210	-670	-660	-1060	-380	300	650	920	1560	1790	2410	2130	2240	2310	2850	2330
-230	-350	-360	-1110	-410	290	620	920	1160	1370	1990	1670	1760	1810	2350	1790
-250	-240	20	790	50	690	1040	940	1620	1850	2510	2680	2810	2900	3500	2960
-270	-90	160	-740	20	780	1130	1010	1710	1940	2620	2790	2920	3010	3630	2480
-290	-230	-30	-1020	-260	500	850	670	1370	1580	2260	2410	2520	2590	3210	2000
-310	-370	-210	-1300	-540	220	530	330	1030	1280	1900	2030	2120	270	2790	1520
-330	-510	-390	-1580	-820	-40	-230	-10	690	860	1540	1650	1790	1750	2370	1040

9:40 IB W40 – 11/21/2025

\$	40	60	80	100	120	140	160	180	200	220	240	260	280	300	320
-50	90	180	290	600	1040	1290	1290	1670	1800	2160	1940	1950	1920	1850	1740
-70	400	640	270	640	1160	1470	1260	1720	1890	2310	2110	2160	2170	2140	2070
-90	340	690	240	840	1230	1580	1640	2160	2390	2890	2730	2840	2910	2940	2930
-110	360	660	520	1200	1880	2310	2430	3050	3360	3960	3860	4050	4200	4310	4380
-130	290	770	330	1030	1730	2430	2550	3210	3540	4180	4080	4290	4460	4590	4680
-150	70	510	-50	850	1350	2050	2130	2790	3100	3740	3600	3790	3940	4050	4120
-170	60	480	-180	540	1260	1980	2370	3070	3400	4080	3530	3720	3420	3510	3560
-190	-140	240	540	180	900	1620	1990	2690	3000	3680	3070	3240	2900	2970	3000
-210	-340	0	-610	110	670	1260	1610	2310	2600	3280	2610	2760	2870	2940	2440
-230	-540	-240	-950	-210	530	900	1230	1930	2200	2880	2150	2280	2370	2420	1880
-250	-450	-170	-960	-200	560	930	1260	1980	2250	2950	2670	2820	2930	3000	2460
-270	-630	-390	-1280	-520	240	980	900	1620	1870	2570	2250	2380	2470	2520	1940
-290	-810	-410	-1600	-840	-80	150	540	1260	1490	2190	1830	1940	2010	2040	1420
-310	-990	-830	-1920	-1160	-400	-90	180	900	1110	1810	1410	1500	1550	1560	900
-330	-1170	-1050	-2240	-1480	-720	-430	-199	540	730	1430	990	1060	1090	1080	380

9:40 IB W40 – 12/05/2025

\$	40	60	80	100	120	140	160	180	200	220	240	260	280	300	320
-50	170	60	190	650	1110	1380	1400	1800	1950	2330	2130	2160	2150	2100	2010
-70	480	500	-20	500	1020	1330	1140	1580	1750	2170	1970	2020	2380	2370	2320
-90	290	360	-280	280	630	940	960	1440	1630	2090	1890	1960	2360	2370	2340
-110	140	300	-80	350	970	1340	1400	1960	2210	2750	2590	2720	3200	3270	3300
-130	30	320	-140	310	970	1630	1710	2330	2620	2870	2710	2860	3380	3470	3520
-150	-40	210	-580	-150	510	1170	1210	1830	2100	2330	2130	2260	2780	2850	2880
-170	-70	140	-770	-340	340	1020	1370	2030	2320	2570	1960	2090	2180	2230	2240
-190	-290	-140	-1190	-780	-100	580	910	1570	1840	2070	1400	1510	1580	1610	1600
-210	-510	-420	-1030	-600	120	490	820	1500	1770	2000	1290	1400	1470	1500	1490
-230	-730	-700	-1410	-1000	-280	70	380	1060	1310	1520	750	840	890	900	870
-250	-660	-670	-1460	-1050	-310	40	350	1050	1300	1510	1190	1300	1370	1400	1390
-270	-860	-930	-1820	-1430	-690	-360	-70	630	860	1050	690	760	830	840	810
-290	-1060	-1190	-2180	-1810	-1070	-760	-490	210	420	590	190	260	290	280	250
-310	-1260	-1080	-2150	-1780	-1020	-710	-440	280	490	660	240	310	340	350	280
-330	-1460	-1320	-2490	-2140	-1380	-1090	-840	-120	70	220	-240	-190	-180	-210	-280

En esta semana estaremos comparando los mapas de calor de las ultimas semanas del IB 9:40 W40. Aquí algunos resultados para investigar:

En cuanto a los valores de los Stop Loss:

- Los Stop Loss medios funcionan mejor ($-110, -130, -150$)
- Los SL pequeños ($-50, -70$) muestran muchos verdes pero no generan buenas ganancias.
- A medida que el SL se amplía, la matriz se vuelve más verde y coherente.

Los Take Profit altos (220 a 320) son los únicos que mantienen ganancia estructural

En prácticamente todos los mapas:

- TP bajos (100–160) aparecen en naranja → inconsistentes
- TP medios (180–220) mejoran, pero siguen mixtos
- TP altos (240–320) → **zona más estable, más verde, más rentable**

La “Sweet Spot Zone” de las 9:40 W40

SL entre -110 y -150 + TP entre 240 y 320

PRÓXIMA SEMANA – SEMANA 50 [12/08/2025 – 12/12/2025]

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	-\$50.00
IB 09:30 50W	\$320.00	-\$90.00
IB 09:40 40W	\$320.00	-\$110.00
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	\$120.00	-\$50.00
IC 10:30 d10 w20	\$40.00	-\$130.00
IC 09:30 d15 w10	\$140.00	-\$50.00
IC 10:30 d15 w10	\$100.00	-\$50.00

NOTA FINAL

La Semana 49 representa un paso hacia la estabilidad dentro de un ciclo más amplio donde las estrategias neutrales vienen siendo desafiadas por la falta de retrocesos y la direccionalidad del SPX. Aun así, esta semana mostró mejoras claras, especialmente en **9:40 W40** y **11:30 W40**, reforzando que el sistema responde bien cuando el mercado ofrece estructuras más limpias.

El análisis estadístico trimestral sigue siendo contundente:

La 9:40 IB W40 continúa siendo la ventana más robusta del modelo,

y la única que mantiene ventaja evidente en el largo plazo.

El sistema sigue sólido, disciplinado y preparado para capitalizar la recuperación del rango neutral cuando el mercado vuelva a ofrecer condiciones óptimas.

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.