

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SEMANA 4 [1/20/2025 – 1/24/2025]

Hola traders! Bienvenidos a otra edición de nuestro boletín semanal, donde desglosamos el comportamiento de las estrategias de Iron Butterfly e Iron Condor en el SPX. Esta semana que pasó, observamos algunos patrones interesantes que podrían ajustar nuestras expectativas y estrategias para los próximos días. Aquí te traemos el análisis completo de lo que ha ocurrido y cómo puedes aprovechar estos insights en tu trading.

Resumen Semanal

Por empezar, notamos una leve mejora en cuanto a los resultados en la mayoría de los horarios. Todas las estrategias resultaron positivas en el acumulado semanal (ver cuadro más abajo). Aunque el horario de la estrategia IB 9:30 W30 0DTE tuvo 3 resultados negativos de 4 días que tuvo la semana hay que tener en cuenta el ratio beneficio/riesgo que tenía esta estrategia durante esta semana, en donde la pérdida máxima es de \$50.00, con una ganancia o Take Profit en \$320.00. Por lo tanto, incluso al haber tenido 3 días negativos, hubo una ganancia en la semana de \$170.00.

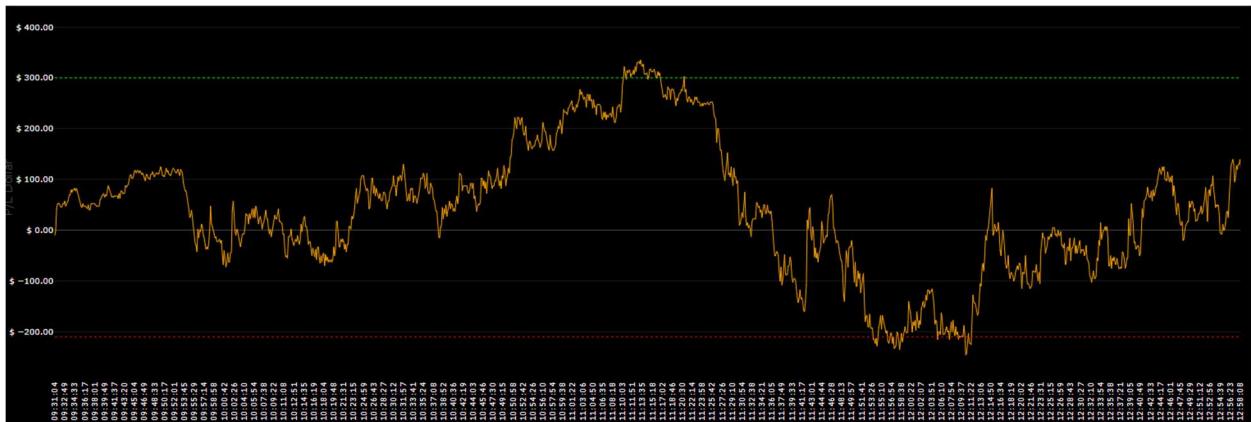
	9:30 w30	9:30 w50	9:40 w40	10:30 w40	11:00 w40	11:30 w40
Fri, 01/24/2025	✗	✓	✓	✓	✓	✗
Thu, 01/23/2025	✗	✓	✓	✗	✗	✓
Wed, 01/22/2025	✗	✓	✓	✓	✓	✓
Tue, 01/21/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✗
Mon, 01/20/2025	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

TP	\$320	\$300	\$140	\$200	\$60	\$300
SL	-\$50	-\$210	-\$250	-\$50	-\$130	-\$210
GANANCIA/PERDIDA	\$170.00	\$1,200.00	\$560.00	\$550.00	\$50.00	\$180.00

La estrategia estrella  de esta semana, fue la mejor en estos últimos meses. La siempre confiable e imbatible IB 9:30 con alas de 50 puntos. Con un TP de \$300.00 y un SL de -\$210.00 ha sacado un 100% de win rate (4 de 4). Aunque, cabe mencionar que hubo dos días en los cuales **apenas** superó el TP para luego rebotar e irse al SL.

Las siguientes figuras muestran la evolución de las ganancias/pérdidas para esta estrategia el miércoles 22 y jueves 23. Véase cómo llegó a nuestro TP y luego cayó hasta el SL (igual se consideran días positivos, debido a que se alcanzó primero el TP)

Día: 1/22/2025



Día: 1/23/2025



Nota: en ambos días, apenas tocó el TP de \$ 300.00, a los pocos minutos, la estrategia se derrumbó y llegó a números negativos, por lo que hay que estar pendiente para salir de la operación ni bien lleguemos a nuestro precio objetivo.

Otra estrategia que se comportó con 100% de acierto fue la IB del horario 9:40 con alas de 40 puntos. Si bien tuvo un acierto de 4 de 4, la ganancia semanal fue de \$ 560.00 debido a que manejó un TP de \$140.00 en esta semana.

Por lo que se ha visto esta semana, queda muy en claro que no siempre tener una racha negativa significa que estamos perdedores. Lo demuestra claramente la estrategia 9:30 w30. Siempre nos debemos fijar en el ratio beneficio/riesgo (o riesgo/recompensa como algunos lo llaman). A veces perderemos muchas veces, pero quizás un día de ganancia sirve para recuperar las pérdidas anteriores.

PROXIMA SEMANA – SEMANA 5 [1/27/2025 – 1/31/2025]

Esta próxima semana vemos que las estadísticas de los últimos 3 meses han cambiado considerablemente el par TP y SL en la estrategia: IB 9:30 w30, donde pasamos de un ratio beneficio/riesgo de 1:0.32 (TP 320 / SL -50) a un ratio totalmente opuesto de 1:6.4 (TP 60 / SL -190). Esto quiere decir que vamos a tener muchos días más positivos (en teoría) ya que alcanzar un TP de \$60, es más factible que llegar a un SL de -\$190. Pero un día negativo, requiere de 3 días positivos para llegar a un breakeven o recuperación de la pérdida.

A continuación, se muestran las mejores combinaciones de TP/SL para esta próxima semana:

9:30 W30 0DTE				9:30 W50 0DTE				9:40 W40 0DTE			
% TP		\$ SL		% TP		\$ SL		% TP		\$ SL	
19%	-8%	60	-190	16%	-11%	320	-150	6%	-19%	140	-250
10:30 W40 0DTE				11:00 W40 0DTE				11:30 W40 0DTE			
% TP		\$ SL		% TP		\$ SL		% TP		\$ SL	
13%	-8%	220	-50	11%	-18%	240	-290	14%	-9%	300	-210

Mapas de Calor

Seguimos estudiando el comportamiento de las estrategias a través de los mapas de calor. Estos nos indican cuáles son los mejores pares de TP/SL durante los últimos 3 meses.

\$	40	60	80	100	120	140	160	180	200	220	240	260	280	300	320
-50	-150	-90	-190	0	150	-120	120	130	350	570	790	700	900	1100	1300
-70	-500	-370	-360	-130	-130	-420	-140	-110	150	410	670	270	490	710	930
-90	-160	180	-70	50	90	-180	180	270	610	950	1290	580	860	1140	1420
-110	-330	160	-340	-450	-450	-780	-420	-350	-10	330	670	-100	180	460	740
-130	-120	410	-150	-260	-240	-570	-150	-40	360	760	1160	380	730	1070	1410
-150	-170	360	-300	-450	-180	-530	-70	60	500	940	1380	1000	1400	1800	2200
-170	-180	350	-160	-330	-40	-720	-240	-110	-20	420	860	440	840	1240	1640
-190	-150	380	-210	-420	-130	-870	-370	-240	-150	-10	340	330	750	1170	1080
-210	-330	160	70	-160	150	-630	-90	60	170	240	720	730	1190	1650	1580
-230	-510	270	120	-480	-190	-1050	-510	-380	-290	-240	240	230	690	1150	1060
-250	-690	90	-120	-800	-530	-1470	-930	-820	-750	-720	-240	-270	190	650	540
-270	-560	-90	-360	-1120	-870	-1890	-1350	-1260	-1210	-1200	-720	-770	-310	150	20
-290	-720	-270	-600	-1440	-1210	-2310	-1770	-1700	-1670	-1680	-1200	-1270	-810	-350	-500
-310	-530	-80	-450	-1350	-1120	-2280	-1720	-1650	-1620	-1630	-1130	-1200	-720	-240	-390
-330	-670	-240	-670	-1220	-990	-1740	-1140	-1050	-1000	-990	-450	-500	20	540	410

Estrategia IB 9:30 w50
En el círculo se puede ver cuál es el mejor rango de combinación TP/SL. Podemos ver que se nos permite ir a buscar un TP de \$240 o mayor pero no llevar los SL a mas de \$230. En la muestra no están incluidos los días con noticias relevantes.

Conclusiones y Expectativas para la Próxima Semana

1. Según nuestras estadísticas y el estudio detallado de los datos de las últimas semanas, la estrategia de Iron Butterfly implementada a las 9:30 con alas de 50 puntos ha mostrado un rendimiento notable. Los puntos de Take Profit y Stop Loss que han coincidido con los mejores resultados fueron establecidos en \$320 y -\$150, respectivamente. Presentamos estos hallazgos únicamente como información para que nuestros lectores tengan un panorama más amplio de las tendencias observadas y puedan hacer sus propias evaluaciones en base a sus estrategias de trading.
2. También es preciso mencionar que se ha observado una mejora significativa en el rendimiento de las estrategias implementadas durante la media mañana (10:30, 11:00 y 11:30) que venían de capa caída. Estas han mostrado un desempeño superior en comparación con las semanas anteriores. Dada esta tendencia, podría ser beneficioso para los traders mantener un monitoreo de estas estrategias en las próximas sesiones.
3. En nuestras últimas revisiones de datos, hemos notado un cambio considerable en la estrategia de Iron Butterfly de las 9:30 con alas W30 en cuanto a los puntos de Take Profit y Stop Loss. Actualmente, los datos indican que un Take Profit más conservador, fijado en solo \$60, junto con un Stop Loss más amplio de -\$190, podría ser más efectivo bajo las condiciones de mercado actuales. Estos ajustes reflejan un enfoque diferente que los traders podrían considerar al evaluar sus propias decisiones de trading.

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.