

Bienvenidos al Boletín Semanal de Análítica SPX

SEMANA 5 [1/27/2025 – 1/31/2025]

Bienvenidos a otra edición de nuestro boletín semanal, en el cual desglosamos el comportamiento de las estrategias de Iron Butterfly aplicadas al SPX. La semana pasada fue particularmente desafiante debido a factores macroeconómicos significativos, incluyendo la reunión del FOMC o el reporte del Índice de Precios de Gastos de Consumo Personal (PCE). Estos eventos han influido notablemente en el mercado, el cual ha tenido comportamientos muy turbulentos en varios días y en diferentes horarios.

Resumen Semanal

La semana que acaba de finalizar estuvo marcada por una intensa volatilidad. Eventos clave como la reunión del FOMC y el reporte de PCE desencadenaron oscilaciones significativas en el mercado, manifestadas en velas Tiburón (alcistas y bajistas) que desafiaron la calma de los traders más sosegados e hicieron “saltar” muchos Stop Loss.

Como podemos ver las 2 estrategias de apertura (IB 9:30 con alas de 30 y alas de 50) tuvieron una semana negativa, aun teniendo pares de TP/SL significativamente no correlacionados (es decir que sus ratios beneficio/riesgo eran muy diferentes). Estos resultados se vieron reflejados por altos GAPs intradía que hubo en la semana, sobre todo el día lunes (+2%) y el viernes (+0.40%). Ambas estrategias de apertura arrojaron una pérdida de \$200 y \$280 respectivamente. En el siguiente gráfico se puede ver el comportamiento de todos los horarios.

	9:30 w30	9:30 w50	9:40 w40	10:30 w40	11:00 w40	11:30 w40
Fri, 01/31/2025	✓	✗	✗	✗	✓	✓
Thu, 01/30/2025	✗	✗	✓	✗	✗	✓
Wed, 01/29/2025	✓	✓	✓	✗	✗	✗
Tue, 01/28/2025	✗	✗	✓	✓	✗	✗
Mon, 01/27/2025	✓	✗	✓	✗	✓	✓
TP	\$60	\$320	\$140	\$220	\$240	\$300
SL	-\$190	-\$150	-\$250	-\$50	-\$290	-\$210
GANANCIA/PERDIDA	-\$200.00	-\$280.00	\$310.00	\$20.00	-\$390.00	\$480.00

La estrategia estrella ☆ de esta semana, fue la **IB 11:30 w40** con una ganancia de \$480.00, dos días negativos y 3 días positivos. Cabe mencionar que esta es la estrategia que motivó el inicio de este proyecto, ya que se pensaba que al mediodía el mercado es más propenso a estabilizarse y mantenerse neutral, aunque luego se descubrió (gracias a la estadística) que existen muchos horarios “óptimos” para operar el mercado, sobre todo teniendo información y datos que nos avalen los resultados.

Esta longeva estrategia ha calificado como la 2da mejor del mes de enero 2025, detrás de la **IB 9:30 w50**. Aquí los resultados mensuales y el podio correspondiente:

Podio de enero 2025



Estrategia	G/P
IB 10:30 w40	\$ 120.00
IB 11:00 w40	\$ 10.00
IB 9:30 w30	\$ -110.00

PROXIMA SEMANA – SEMANA 6 [02/03/2025 – 02/07/2025]

En la semana entrante y debido a la mala racha que venimos obteniendo en la estrategia IB 9:30 w30, el algoritmo detectó que es conveniente abrir los márgenes de TP/SL. Es decir, veníamos de un TP/SL de 60/-190 para pasar a uno más amplio de 320/-310 (un ratio R/R de casi 1:1, arriesgando \$310 para ganar \$320)

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	TP	SL	TP	SL	TP	SL
6%	-18%	320	-310	16%	-19%	320	-150	6%	-19%	140	-250

🦋 10:30 W40 0DTE				🦋 11:00 W40 0DTE				🦋 11:30 W40 0DTE			
%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
12%	-19%	240	-90	11%	-18%	40	-290	15%	-9%	320	-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.

Ahora haremos una comparación de los mapas de calor correspondientes a la estrategia IB 9:30 w50 de la semana 4 y la semana 5 del vigente año en los último 3 meses. Seguimos observando el mismo patrón que sigue manteniendo la mayor ganancia en el par TP 320 / SL -150.

Semana 4, 2025

\$	40	60	80	100	120	140	160	180	200	220	240	260	280	300	320
-50	-150	-80	-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	160	-70	90	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	390	730	1070	1410
-150	-170	360	-300	-450	-180	-530	-78	60	500	940	1380	1000	1400	1800	2200
-170	-180	350	-180	-330	-40	-720	-340	-110	-30	430	860	440	840	1240	1640
-190	-150	380	-210	-420	-130	-870	-370	-240	-150	-100	340	330	750	1170	1080
-210	-330	180	90	-160	150	-630	-90	60	170	340	720	730	1190	1650	1580
-230	-510	270	130	-480	-190	-1050	-510	-380	-250	-240	240	230	690	1150	1060
-250	680	90	120	-800	-530	-1470	-830	-820	-750	-720	-240	-270	190	650	540
-270	-560	-80	-360	-1120	-870	-1890	-1350	-1260	-1210	-1200	-720	-770	-310	150	30
-290	-720	-270	400	-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	340	-390
-330	-670	-340	470	-1220	-990	-1740	-1140	-1050	-1000	-990	-450	-500	30	540	410

Semana 5, 2025

\$	40	60	80	100	120	140	160	180	200	220	240	260	280	300	320
-50	-70	30	-30	50	220	-30	230	30	250	470	690	600	800	1000	1200
-70	-420	-290	-300	-100	-80	-350	-90	0	10	270	530	130	350	570	790
-90	-210	150	90	60	120	120	250	360	430	770	1110	400	680	960	1240
-110	-400	110	-180	-460	-440	-750	-370	-380	-230	110	450	350	40	240	520
-130	-210	340	10	-290	-250	-560	-120	10	100	500	900	130	470	810	1150
-150	-380	270	-140	-500	-210	-540	-40	90	200	640	1080	700	1100	1500	1900
-170	-310	240	-250	-670	-380	-1060	-580	-450	-360	80	520	105	590	900	1300
-190	-530	9	-590	-1090	-820	-1580	-1100	-990	-800	-480	-40	-50	570	790	700
-210	-500	30	-480	-580	-270	-1050	-510	-360	-230	250	750	780	1260	1740	1690
-230	-700	130	-30	-940	-450	-1510	-970	-840	-750	-250	250	260	740	1220	1150
-250	-900	-180	-290	-1300	-1030	-1970	-1430	-1320	-1250	-750	-250	-260	220	700	610
-270	-790	-300	-550	-1660	-1410	-2430	-1890	-1800	-1750	-1250	-750	-780	-300	180	70
-290	-870	-500	-810	-2020	-1790	-2890	-2350	-2280	-2250	-1750	-1250	-1300	-820	-340	-470
-310	-800	-330	-680	-1560	-1310	-2450	-1870	-1780	-1730	-1190	-650	-680	-180	360	250
-330	-860	-510	-820	-1450	-1200	-1930	-1310	-1200	-1130	-590	30	30	580	1140	1050

En este boletín haremos una breve explicación de lo que hace un mapa de calor de este tipo para los que todavía tengas dudas:

Componentes

1. Cabecera superior: Muestran posibles TP (Take Profit)
2. Cabecera lateral (izquierda): Muestran posibles SL (Stop Loss)
3. Celdas: Muestran las ganancias/perdidas para cada combinación de TP y SL
4. Color: Un color verde oscuro indica una ganancia mayor y a medida que se aclara el verde, indica una ganancia menor. Un rojo oscuro indica una pérdida mayor y a medida que es menos intenso, indica una pérdida menor.

Algoritmo

Lo que hace el sistema es realizar un barrido de cada combinación posible de TP/SL. En otras palabras: para una determinada estrategia (por ejemplo, IB 9:30 50w) el algoritmo calcula cuál sería la ganancia/pérdida si colocáramos un TP de \$40 y un SL de -\$50. Luego, qué pasaría con un TP de \$40 también, pero ahora con un SL de -\$70. Luego un TP de \$40 y un SL de -\$90 y así para toda la columna de TP \$40. Luego hará lo mismo para un TP de \$60, combinándolo ahora con un SL de -\$50, luego -\$70, luego -\$90, etc. De esta manera y luego de chequear todos los TP contra todos los SL, se creará un matriz con un resultado (ganancia/pérdida) para cada combinación.

Colorización

Los resultados se colorean según el patrón indicado en el punto 4 de la sección Componentes.

Resultados

De esta manera y viendo los colores podremos observar fácil y rápidamente cuáles son las mejores combinaciones o pares de TP/SL durante un determinado lapso de tiempo para una determinada estrategia. Además, sirve para determinar si una estrategia está siendo positiva o negativa en general (si se observa un mapa muy rojo, se debería hacer una revisión o ponerla en stand by por un tiempo).

Conclusiones y Expectativas para la Próxima Semana

1. Esta semana, haremos un mayor seguimiento para ver cómo se comporta la estrategia IB 9:30 30w ya que ha sido la que ha tenido un cambio considerable en sus TP/SL como mencionamos mas arriba.
2. Un seguimiento también a la estrategia IB 9:40 w40 que en base a la nueva combinación de TP/SL de esta semana (TP 140 /SL -250) tiene un porcentaje de acierto de 86.67% para los últimos 15 días.
3. Notar que el nuevo par TP/SL para el horario de las 11:00 tiene un 100% de acierto, pero con un TP muy accesible de solo \$40. Si bien esto es positivo porque vamos a tener muchos aciertos, el SL de -\$290 hará que temblemos cuando nos toque el SL un día. Por eso es recomendable tener cuidado con estos tipos de pares que tienen un ratio riesgo/recompensa donde arriesgamos 1 para obtener solo 0.14.