

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SEMANA 7 [2/10/2025 – 2/14/2025]

Bienvenidos a una nueva edición de nuestro boletín semanal, donde analizamos en detalle el desempeño de las estrategias Iron Butterfly en el SPX.

Esta semana que pasó hemos tenido resultados mixtos. Horarios que han tenido resultados positivos y otros negativas. Sin embargo, el resultado final fue positivo (otra semana más), lo que nos permite concluir que vamos por buen camino, sobre todo si lo llevamos a largo plazo. Tener una disciplina y constancia es fundamental. ¡¡¡Seguir el plan en base a datos y estadística es nuestro objetivo!!!

Resumen Semanal

Esta semana, de los seis horarios que seguimos en este reporte, tres tuvieron un resultado positivo y tres fueron negativos. A pesar de ello, el balance total de la semana fue positivo, con una ganancia de **\$790.00**.

En cuanto al desempeño general, registramos 15 operaciones exitosas y 15 desfavorables, lo que nos da un porcentaje de aciertos del 50%. Un dato interesante a destacar es que el jueves todas las estrategias resultaron negativas, mientras que el viernes todas fueron positivas. Esto sugiere que el jueves fue un día altamente direccional, mientras que el viernes, en contraste, presentó un comportamiento mucho más neutral.

El siguiente cuadro detalla el comportamiento de los Iron Butterflies de esta semana que acaba de terminar:

	9:30 w30	9:30 w50	9:40 w40	10:30 w40	11:00 w40	11:30 w40
Fri, 02/14/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Thu, 02/13/2025	✗	✗	✗	✗	✗	✗
Wed, 02/12/2025	✗	✗	✓	✗	✗	✗
Tue, 02/11/2025	✓	✓	✓	✗	✓	✗
Mon, 02/10/2025	✓	✓	✗	✓	✗	✓
TP	\$320	\$320	\$140	\$240	\$240	\$300
SL	-\$310	-\$150	-\$250	-\$90	-\$290	-\$210
GANANCIA/PERDIDA	\$340.00	\$660.00	-\$80.00	\$210.00	-\$390.00	-\$30.00

IB 9:30 con alas de 50 puntos. Esto ya es cosa seria.

Otra vez la estrategia/horario que abrimos a las 9:30 (hablamos del Iron Butterfly de las 9:30 con alas de 50 puntos) fue la mejor. Sigue siendo altamente rentable y supera por amplio margen a las demás.

Seguimos pensando que abrir las alas, aunque pongamos mas colateral, nos da mejores resultados a largo plazo. La semana que viene haremos un estudio mas profundo de esta estrategia, abarcando temas como esperanza matemática, créditos, tiempos de salida, etc.

La estrategia **IB 10:30 40W**, a pesar de haber tenido tres días negativos y solo dos positivos, cerró la semana con un resultado favorable. Esto refuerza un principio clave del trading: lo más importante no es la cantidad de operaciones ganadoras o perdedoras, sino el balance final entre ganancias y pérdidas.

En este caso, operamos con un Take Profit (TP) de \$240 y un Stop Loss (SL) de -\$90, lo que significa que, aunque el porcentaje de aciertos sea bajo, el factor determinante es que las ganancias superen a las pérdidas. Para lograrlo, es imprescindible mantener una disciplina rigurosa y adherirse al plan de trading sin desviaciones.

Este enfoque exige un alto nivel de compromiso y fortaleza mental, ya que es fundamental resistir las rachas negativas sin perder confianza en la estrategia. La gestión emocional desempeña un papel crucial en la consistencia y el éxito a largo plazo.

IRON CONDORS

Hablemos de unas estrategias que también seguimos en la Analítica SPX: los Iron Condors. En la plataforma estamos siguiendo y recabando información de ya hace bastante tiempo con las siguientes estrategias/horarios:

1. **IRON CONDOR a las 9:30hs alas de 20 puntos con delta cercano a 0.10**
2. **IRON CONDOR a las 10:30hs alas de 20 puntos con delta cercano a 0.10**

Aquí, a título informativo mostramos la evolución del último mes de la segunda estrategia de dichos horarios:

IRON CONDOR 10:30 D10 W20 (Delta .10 y alas a 20 puntos)

11/18/2024 – 2/14/2025

TP \$ 80 – SL -\$290

Días Positivos
46

Días Negativos
6

Radio Ganancia
88.46%

P/G
\$ 1940.00

Hemos observado que en los últimos tres meses la estrategia ha mostrado una alta rentabilidad con un TP de \$80 y un SL de -\$290. Hemos obtenido **40 días positivos y solo 6 negativos** con una efectividad de 88.46%. Wow!!! Eso es impresionante. Si bien es cierto que la relación entre ganancia y pérdida es muy distante, los datos respaldan la idea de que seguir un plan de trading estructurado puede ser una estrategia efectiva.

Cuando identificamos un par TP/SL que demuestra ser rentable a largo plazo, vale la pena analizarlo en mayor profundidad y considerar su aplicación futura. Continuaremos monitoreando los Iron Condors para obtener más información relevante que nos ayude a optimizar nuestro enfoque de trading.

PROXIMA SEMANA – SEMANA 9 [02/18/2025 – 02/21/2025]

La próxima semana será más corta de lo habitual debido al feriado del lunes 17 de febrero, en conmemoración del Día de los Presidentes en Estados Unidos.

En general, hemos mantenido los mismos niveles de Take Profit (TP) y Stop Loss (SL) que la semana anterior, lo que sugiere que la estructura del mercado no ha cambiado significativamente en los últimos tres meses.

Sin embargo, la estrategia IB 10:30 40W ha mostrado una variación notable: su TP aumentó de \$240 a \$320, mientras que el SL se redujo de -\$90 a -\$50. Esto indica que, si bien es probable que el porcentaje de aciertos sea bajo, un solo día ganador podría compensar hasta seis días de pérdidas.

Este ajuste tiene tanto ventajas como desventajas: por un lado, ofrece la posibilidad de recuperar pérdidas rápidamente, pero por otro, requiere tolerar períodos de aciertos bajos sin desviarse del plan. Observaremos de cerca su desempeño en la próxima semana para evaluar su efectividad.

En la siguiente tabla, podemos ver los mejores TP/SL para la semana entrante (basado en las estadísticas de los últimos 3 meses, tanto a nivel nominal como porcentual):

🦋 9:30 W30 0DTE				🦋 9:30 W50 0DTE				🦋 9:40 W40 0DTE			
%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
10%	-16%	320	-310	12%	-7%	320	-150	7%	-18%	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
19%	-7%	320	-50	11%	-19%	240	-290	16%	-17%	320	-210

Conclusiones y Expectativas para la Próxima Semana

¿Qué esperar en los próximos cuatro días de mercado?

Nuestro objetivo es continuar ejecutando el plan de trading con disciplina y mantener los resultados positivos que respaldan las estadísticas y probabilidades. Seguir un enfoque estructurado y basado en datos sigue siendo clave para optimizar el rendimiento y aprovechar las oportunidades del mercado.

Estaremos pendiente de dos estrategias específicamente:

1. **IB 9:30 50w:** Nuestra estrategia estrella sigue dando buenos resultados y no ha variado la configuración de su par TP/SL en las últimas 3 semanas. Eso indica la robustez de la estrategia y que podemos confiar en dicha configuración a corto plazo.
2. **IB 10:30 40w:** Como sabemos esta estrategia/horario ha tenido pares TP/SL con ratios de beneficio/riesgo muy distantes en las últimas semanas. Es decir que la diferencia entre el TP y el SL son muy grandes. Mas arriba se mencionaron los nuevos valores, así que solo resta ver cómo se comportan los números finales. Es importante considerar que esta configuración puede ser óptima para cuentas pequeñas, ya que indica que podemos perder poco en cada entrada (-\$50) y ganar mucho (\$320), aunque como mencionamos antes el nivel de acierto será bajo ya que un mínimo movimiento (alcista o bajista) hará que salte nuestro Stop Loss.
3. Para el resto de los horarios, no se han registrado cambios significativos, por lo que continuaremos monitoreando y analizando sus resultados. Nuestro enfoque sigue siendo validar, a través de datos y experiencia, que el mejor camino en el trading es un proceso meticuloso que combina estudio, backtesting y confianza en las estadísticas.
Más allá de la estrategia utilizada, el éxito a largo plazo depende de seguir un plan bien estructurado y mantener una mentalidad disciplinada. La psicología del trader juega un papel fundamental, ya que la paciencia y la gestión emocional son tan importantes como los números. Seguiremos recopilando información para optimizar nuestras decisiones y fortalecer la solidez de nuestro enfoque.

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.