

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SEMANA 8 [2/17/2025 – 2/21/2025]

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

Esta semana fue corta pero positiva. Debido al feriado del Día de los Presidentes el lunes 17 de febrero, solo operamos cuatro días, pero los resultados fueron sólidos. Todas las estrategias cerraron en verde, lo que refuerza nuestra confianza en el plan y en la importancia de seguir la estadística con disciplina.

Resumen Semanal

De los horarios que seguimos en este reporte, 13 estrategias fueron positivas y 11 negativas, lo que nos dio un balance favorable. El total de ganancias de la semana fue de **\$1,310.00**, confirmando una vez más que la consistencia y la gestión de riesgo son claves en este proceso.

Semana tras semana, los datos nos demuestran que seguir un enfoque basado en estadísticas y probabilidades es la mejor manera de operar con confianza. ¡Seguimos adelante, enfocados en el largo plazo y en la disciplina operativa!

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, 02/21/2025	✗	✗	✓	✓	✓	✗
Thu, 02/20/2025	✗	✗	✗	✗	✓	✓
Wed, 02/19/2025	✓	✓	✓	✗	✗	✗
Tue, 02/18/2025	✓	✓	✓	✗	✓	✓
Mon, 02/17/2025	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

TP	\$320	\$320	\$140	\$320	\$240	\$300
SL	-\$310	-\$150	-\$250	-\$50	-\$290	-\$210
GANANCIA/PERDIDA	\$20.00	\$340.00	\$170.00	\$170.00	\$430.00	\$180.00

Las estrategias siguen en verde, con IB 9:30 W50 destacándose nuevamente.

Otra semana positiva, con todas las estrategias en saldo ganador. A pesar de que hubo días con resultados mixtos, el balance final refuerza la importancia de seguir el plan con disciplina.

IB 9:30 w50: sigue siendo la mejor.

Nuevamente, el **Iron Butterfly de las 9:30 con alas de 50 puntos** fue la segunda estrategia más rentable de la semana, sumando \$340.00. Esto confirma que mantener una estructura más amplia y asumir un mayor colateral sigue dando frutos a largo plazo.

IB 10:30 w40: el equilibrio entre aciertos y pérdidas.

A pesar de que esta estrategia tuvo tres días negativos y solo uno positivo, cerró con un resultado

favorable de **\$170.00**. Este es un gran recordatorio de que en el trading no importa cuántas veces pierdas, sino cuánto ganas cuando aciertas. Con un TP de \$320 y un SL de \$50, el riesgo/recompensa estuvo bien equilibrado.

IB 11:00 w40, la sorpresa de la semana.

La estrategia de 11:00 W40 se destacó con una ganancia de \$430.00, siendo la más rentable del grupo. Aunque el porcentaje de aciertos no siempre fue alto, su balance final demuestra que las salidas bien gestionadas pueden marcar la diferencia.

Conclusión

El balance final de la semana fue **\$1,310.00**, otra muestra de que la consistencia y la gestión del riesgo son claves.

PROXIMA SEMANA – SEMANA 9 [02/24/2025 – 02/28/2025]

Prácticamente sin cambio de TP/SL para todas las estrategias de IB (esto es super bueno y demuestra la consistencia de las estrategias). El cambio más sustancial fue el del **IB 10:30 40w** donde levantamos considerablemente el ratio Riesgo/Recompensa para esta semana, denotando un TP de **\$320** contra un SL de **-\$130**.

Un dato interesante es que **4 de los 6 horarios tienen un TP de \$320**. ¿Qué implica esto? Ese **es el valor máximo que el algoritmo verifica**, lo que significa que el sistema **cierra la operación en \$320 sin seguir analizando datos más allá de ese punto**.

En otras palabras, existe la posibilidad de que la estrategia continúe generando ganancias después de alcanzar ese umbral, pero al no estar respaldado por datos adicionales, **es preferible mantenerlos dentro de los límites que sí han sido validados estadísticamente**. En trading, **la consistencia y la disciplina superan la especulación**, por lo que seguir una metodología basada en datos es siempre la mejor decisión

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%	-14%	320	-310	16%	-13%	320	-150	6%	-17%	180	-230

10:30 W40 0DTE				11:00 W40 0DTE				11:30 W40 0DTE			
% TP		\$ SL		% TP		\$ SL		% TP		\$ SL	
19%	-7%	320	-130	11%	-14%	240	-290	19%	-9%	320	-210

Conclusiones y Expectativas para la Próxima Semana

Esta semana es la última del mes. Lo que nos permitirá evaluar el total de mes una vez terminada la semana. Por ahora venimos **muy positivos** en todas las estrategias así que a no romper la racha!!!

Nuestro objetivo es **seguir ejecutando el plan con disciplina**, confiando en que los resultados positivos respaldan la ventaja estadística de nuestra estrategia. Mantener un enfoque **racional y basado en datos** es fundamental para maximizar el rendimiento, minimizar la incertidumbre y capitalizar las oportunidades que el mercado nos presenta día a día.

Estaremos pendiente de dos estrategias específicamente:

1. **IB 10:30 40w:** Como mencionamos arriba esta es la estrategia que tuvo mayor cambio en la relación riesgo/beneficio y por ende en su TP y SL. Venía saliendo con un SL muy cortito de -\$50, y el algoritmo lo llevo a -\$130. Veamos como se comporta.
2. **IB 9:30 50w:** Seguiremos monitoreando la mejor estrategia para ver sus resultados y como cerramos el mes. Bien vale la pena darle un vistazo al **reporte especial** con **TODOS** los datos relevantes de esta estrategia que también se puede ver en la sección de Boletines en el **PANEL** de la Analítica SPX.
3. Para el resto de los horarios, no se han observado variaciones significativas, por lo que continuaremos con su seguimiento y análisis. Nuestro enfoque sigue siendo validar, con datos y experiencia, que el trading exitoso es un proceso meticoloso que requiere estudio, backtesting y confianza en las probabilidades.

Más allá de la estrategia en sí, el verdadero factor determinante del éxito a largo plazo es la **consistencia en la ejecución** y el compromiso con un plan bien estructurado. La psicología del trader desempeña un rol crucial: **la paciencia y la gestión emocional son tan importantes como los números.**

Seguiremos recopilando información para perfeccionar nuestra toma de decisiones y consolidar aún más la solidez de nuestro enfoque.

Seguimos en el camino correcto. La clave es la paciencia y la disciplina. Nos vemos en la próxima edición!

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.