

Bienvenidos al Boletín Semanal de Análítica SPX

SEMANA 11 [3/10/2025 – 3/14/2025] –

SEMANA ROJA, PERO LA ESTRATEGIA SIGUE FIRME

Bienvenidos a una nueva edición de nuestro boletín semanal, donde analizamos en detalle el desempeño del mercado y nuestras estrategias durante esta semana de marzo.

Resumen Semanal

Durante esta semana, de las estrategias y horarios que monitoreamos, obtuvimos resultados mixtos con algunos desempeños destacados y otros más desafiantes. El balance semanal final fue de **-\$1,940.00**, reflejando que seguimos en un entorno complejo para nuestras estrategias neutrales. En Análítica SPX no ocultamos las pérdidas, reconocemos que forman parte de las rachas normales del mercado, y mantenemos nuestra confianza en la solidez de las estadísticas y probabilidades sobre las que se basan nuestras estrategias.

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, 03/14/2025	×	×	✓	×	✓	✓
Thu, 03/13/2025	×	✓	✓	×	×	×
Wed, 03/12/2025	×	×	×	×	×	×
Tue, 03/11/2025	×	✓	✓	✓	×	×
Mon, 03/10/2025	×	×	✓	✓	×	×
TP	\$200	\$320	\$180	\$240	\$280	\$320
SL	-\$210	-\$210	-\$330	-\$150	-\$270	-\$210
GANANCIA/PERDIDA	-\$1,050.00	\$10.00	\$390.00	\$30.00	-\$800.00	-\$520.00

Análisis de Estrategias

IB 9:30 w30: Semana complicada

Fue la estrategia con peor desempeño esta semana, acumulando una pérdida de **-\$1,050.00**. Su comportamiento sigue siendo ineficiente en un entorno direccional, por lo que se requiere una revisión de sus parámetros. Sin embargo, hemos notado que en varias ocasiones estuvo cerca de alcanzar el **Take Profit (TP)** antes de revertirse y tocar el **Stop Loss (SL)**. Este comportamiento será analizado más abajo, mostrando gráficos del desenvolvimiento diario.

IB 9:40 w40: La mejor estrategia de la semana

Con un resultado positivo de **\$390.00**, esta estrategia logró destacarse. Su rendimiento demuestra que puede navegar bien en condiciones de mercado mixtas.

IB 9:30 w50: Estabilidad con leve ganancia

Nuestra estrategia estrella en lo que va del año logró mantenerse en equilibrio, cerrando la semana con

una ligera ganancia de **\$10.00**. Aunque no representa un gran retorno, su estabilidad es un punto positivo.

Análisis de IB 9:30 w30: ¿Por qué perdió todos los días?

Una mención especial a esta estrategia/horario. Este análisis se hace porque todos los días de esta semana fueron negativos y es bueno estudiar y ver qué sucedió. Sabemos que estamos en un mercado muy volátil y direccional, lo que significa que podemos estar casi tocando el TP y que luego se revierte hasta tocar el SL, o viceversa.

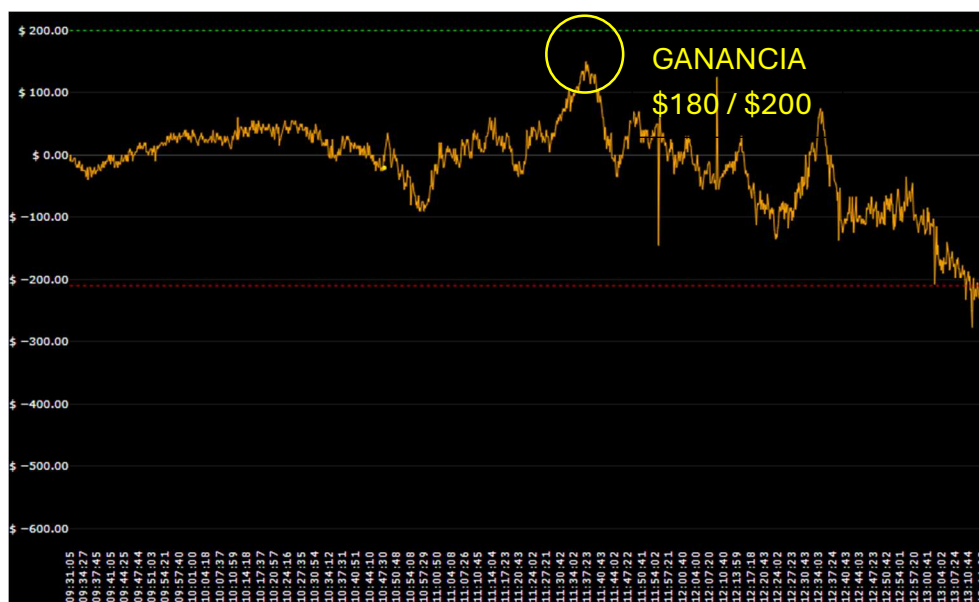
Sin embargo, observamos que, salvo el miércoles 12, los demás días superaron los **\$100** de ganancia antes de revertirse. Esto indica que hubo oportunidades de cerrar con ganancias parciales antes de la reversión. Aquí un resumen de lo máximo que llegó la ganancia antes de revertirse y tocar el SL:

TP/SL de la estrategia/horario esta semana:

- **TP: \$200 / SL: -\$210**

Máxima ganancia alcanzada antes de revertirse:

- **Lunes 10:** \$150 (11:36 AM)
- **Martes 11:** \$180 (11:51 AM)
- **Jueves 13:** \$160 (11:05 AM)
- **Viernes 14:** \$105 (10:37 AM)



A modo de ejemplo, y también para destacar la importancia del análisis de datos históricos y el seguimiento de estrategias que ofrece Analítica SPX, podemos observar lo cerca que estuvo la estrategia el martes 11 de alcanzar su Take Profit (TP) antes de revertirse.

PROXIMA SEMANA – SEMANA 12 [03/17/2025 – 03/21/2025]

Por empezar y después de una mitad de marzo turbulenta, seguiremos estudiando y buscando los mejores parámetros sin escaparnos de las rachas negativas ni dejar de apostar por el plan de trading. Como mencionamos en el último boletín:

A veces es **importante** reconocer que detenerse y esperar a que el mercado se estabilice es una decisión inteligente. **No se trata de abandonar el plan de trading**, sino de tomarse un respiro para reevaluar la situación y ajustarse a las nuevas condiciones del mercado. **Adaptarse** no significa perder consistencia, sino evolucionar con **inteligencia y flexibilidad** en respuesta a los cambios del entorno.

Extracto del boletín de la semana pasada

Podemos observar que el algoritmo ha detectado que la estrategia **IB 9:30 w30** debe ajustar su enfoque. Para la próxima semana, ha configurado una ganancia mínima de \$40 y mantiene un Stop Loss de -\$210. Esto indica que el sistema ha identificado un entorno de alta direccionalidad y volatilidad, priorizando asegurar pequeñas ganancias en lugar de exponerse a reversiones bruscas que han afectado su desempeño en las semanas anteriores.


No es ideal operar con una relación de riesgo/beneficio tan desbalanceada, ya que una sola pérdida requiere al menos cinco días ganadores para recuperarse. Si bien es evidente que la estrategia tendrá un alto porcentaje de días positivos, esto no siempre es suficiente para mantener la rentabilidad a largo plazo. Sería recomendable monitorear de cerca esta combinación de **Take Profit (TP)** y **Stop Loss (SL)** para evaluar posibles ajustes que optimicen el rendimiento.

Por el resto de las estrategias seguimos bastante igual, respecto de la semana pasada. A continuación, los nuevos TP/SL para la semana entrante:

🦋 9:30 W30 0DTE				🦋 9:30 W50 0DTE				🦋 9:40 W40 0DTE			
%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
7%	-5%	40	-210	11%	-7%	320	-210	7%	-16%	180	-330

🦋 10:30 W40 0DTE				🦋 11:00 W40 0DTE				🦋 11:30 W40 0DTE			
%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
9%	-17%	240	-150	6%	-14%	180	-210	19%	-9%	80	-250

En cuanto a la estrategia **IB 11:30 w40**, el algoritmo nos muestra un desbalance en la combinación TP/SL para la próxima semana, estableciendo un Take Profit (**TP**) de \$80 y un Stop Loss (**SL**) de -\$250. Como mencionamos anteriormente, este tipo de configuraciones son arriesgadas, ya que cuando se pierde, la magnitud de la pérdida supera ampliamente la de las ganancias. Vamos a un ejemplo práctico:

Mostrando Todos Los Días	Mar 14	Mar 13	Mar 12	Mar 11	Mar 10	Mar 7	Mar 6	Mar 5	Mar 4	Mar 3	Feb 28	Feb 27	Feb 26	Feb 25	Feb 24	Ratio Aciertos	Par TP/SL
 11:30 W40 ODTE																80.00%	TP: 80 SL: -250 RR: 1:0.32

A simple vista, la estrategia parece sólida, con una alta tasa de aciertos y un historial de días positivos "verdes". Sin embargo, no todo lo que brilla es oro. Apenas tres días negativos fueron suficientes para reducir significativamente las ganancias acumuladas.

 Resultados en los últimos 15 días:

 12 días positivos → Ganancia de \$80 por día = \$960.00

 3 días negativos → Pérdida de \$250 por día = \$750.00

 Ganancia neta total: \$210.00

Más allá de tener razón: la clave es ganar dinero

Es natural sentirse atraído por estrategias con una alta tasa de aciertos. Ver una mayoría de días positivos genera confianza y la ilusión de estar en el camino correcto. Sin embargo, en el trading, **no se trata solo de cuántas veces ganas, sino de cuánto ganas cuando ganas y cuánto pierdes cuando pierdes.**

No es suficiente ganar frecuentemente si esas ganancias no cubren adecuadamente las pérdidas. Aquí es donde entra el concepto de **esperanza matemática positiva**, que debe ser el verdadero foco de cualquier estrategia.

Conclusión:

No es sobre cuántas veces ganas, sino sobre cómo gestionas el riesgo

El verdadero éxito en el trading no viene de ganar muchas veces, sino de ganar **de forma eficiente y sostenible**. Una estrategia con una tasa de aciertos del **50%** pero una relación riesgo/recompensa de **1:2** (donde las ganancias duplican las pérdidas) será **infinitamente más rentable** que una estrategia con **80% de aciertos pero una relación de 1:0.32**, como la que estamos analizando.

Por ello, es fundamental monitorear no solo la tasa de aciertos, sino la **relación entre TP y SL**, y considerar ajustes en la gestión de riesgo. Si una estrategia con alta tasa de aciertos no está generando el retorno esperado, puede ser momento de optimizar su configuración o buscar mejores alternativas.

Nota Final:

En definitiva, el trading no se trata de **tener la razón**, sino de asegurarte de que cuando ganas, ganas lo suficiente como para cubrir tus pérdidas y obtener rentabilidad en el largo plazo.

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.