

Bienvenidos al Boletín Semanal de Analítica SPX

SEMANA 12 [17/3/2025 – 21/3/2025] – SEMANA VERDE: LA PACIENCIA EMPIEZA A PAGAR

Bienvenidos a una nueva edición de nuestro boletín semanal, donde analizamos el desempeño de nuestras estrategias sobre el índice SPX. Esta semana finalmente nos brindó un respiro, con la mayoría de las configuraciones mostrando resultados positivos y un balance general ampliamente favorable.

Resumen Semanal

Después de una semana anterior marcada por pérdidas, esta semana 12 nos ofrece un panorama completamente distinto. De las estrategias evaluadas, **cinco cerraron con ganancias** y solo una arrojó pérdidas. El resultado total fue una **ganancia** de **\$2,350.00**, lo cual representa un fuerte repunte y una validación del enfoque estadístico que seguimos. Estos resultados refuerzan nuestra convicción: **las estrategias basadas en datos y consistencia a largo plazo siempre terminan dando frutos.**

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, 03/21/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Thu, 03/20/2025	✗	✗	✗	✓	✓	✓
Wed, 03/19/2025	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Tue, 03/18/2025	✗	✗	✓	✓	✓	✓
Mon, 03/17/2025	✗	✗	✓	✓	✓	✓
TP	\$40	\$320	\$180	\$240	\$180	\$80
SL	-\$210	-\$210	-\$330	-\$150	-\$210	-\$250
GANANCIA/PERDIDA	-\$550.00	\$10.00	\$390.00	\$1,200.00	\$900.00	\$400.00

Análisis de Estrategias

IB 9:30 w30: Persisten las dificultades

Una vez más, esta estrategia fue la única en cerrar la semana en rojo, con una pérdida de **-\$550.00**. A pesar de los ajustes implementados en su **TP (\$40)**, el mercado sigue mostrando movimientos que complican su desempeño. Continuamos monitoreándola de cerca y analizaremos si es momento de pausarla o reformular su estructura.

IB 9:30 w50: Estabilidad con leve ganancia

Repitiendo el patrón de la semana pasada, esta estrategia logró un pequeño resultado positivo de **\$10.00**. No deslumbra, pero **se mantiene firme** y sin grandes sobresaltos. En algún momento llegó a ser nuestra estrategia estrella, y si bien es la mas ganadora desde que empezó el año a regulado su comportamiento.

IB 9:40 w40: Sólida y consistente

Con una ganancia total de **\$390.00**, esta estrategia sigue mostrando su robustez en semanas de recuperación. Su configuración actual está alineada con la volatilidad presente.

IB 10:30 w40: La estrella de la semana

Con un rendimiento destacado y una ganancia de **\$1,200.00**, fue la estrategia más rentable. Su combinación TP/SL y horario parecen estar muy bien calibrados al contexto actual del mercado.

IB 11:00 w40: Potente recuperación

Logró una ganancia de **\$900.00**, lo que representa un cambio total respecto a semanas anteriores. Es una de las estrategias más sensibles a la direccionalidad del mercado, y esta vez, esa direccionalidad jugó a favor.

IB 11:30 w40: Verde y firme

Con **\$400.00** de ganancia, esta estrategia muestra que puede mantener un rendimiento sostenido incluso con una relación TP/SL exigente. Su alta tasa de aciertos sigue siendo su mayor fortaleza.

Comentario especial: Estamos observando que los primeros minutos del mercado están siendo especialmente volátiles, lo que representa un riesgo mayor para las estrategias de apertura como las de las **9:30**. Recomendamos extremar la precaución en esos horarios. En contraste, las estrategias del mediodía (**10:30, 11:00 y 11:30**) están demostrando un rendimiento brillante y constante. La estabilidad en esos tramos horarios está siendo clave para los resultados positivos de la semana.

Seguimiento a los Iron Condors

	9:30 d10 w20	9:30 d10 w20
Fri, 03/21/2025	☑	☑
Thu, 03/20/2025	✗	☑
Wed, 03/19/2025	☑	☑
Tue, 03/18/2025	✗	☑
Mon, 03/17/2025	✗	☑
TP	\$160	\$100
SL	-\$130	-\$230
GANANCIA/PERDIDA	-\$70.00	\$500.00

Esta semana también analizamos los resultados de las estrategias **Iron Condor** ejecutadas a las **9:30am** y **10:30am** con **delta de 0.10 y ancho de alas de 20 (d10 w20)**. La estrategia de las **9:30** con una pérdida de **-\$70.00** y la de las **10:30** con una ganancia de **\$500.00**. El total muestra una ganancia semanal de **\$430.00**

Pero lo más importante, y comparándolas con los horarios de los Iron Butterflies, queda demostrado que la **zona neutral del mercado se está desplazando hacia los horarios de 10:30 a 11:30**, donde los resultados fueron consistentemente positivos y estables en las últimas semanas.

Conclusión

La **semana 12** marca un punto de inflexión positivo. Luego de semanas con resultados mixtos o negativos, esta semana verde demuestra que la **paciencia** y la **disciplina** valen la pena. No todas las estrategias se recuperan al mismo ritmo, pero el enfoque **estadístico** y la **gestión de riesgo** adecuada continúan siendo el corazón de nuestro sistema.

Seguiremos monitoreando los desempeños individuales, especialmente aquellos que todavía presentan debilidades, y reforzando aquellas configuraciones que ya se destacan.




PROXIMA SEMANA – SEMANA 13 [03/24/2025 – 03/28/2025]




Luego de una semana verde que nos dio aire y confianza, seguimos enfocados en mejorar nuestras configuraciones, siempre dentro del plan, sin perseguir resultados, pero atentos a los ajustes necesarios.

Como anticipamos, la estrategia **IB 9:30 W30** continúa siendo la más golpeada por la volatilidad. El algoritmo ha mantenido una configuración conservadora con **TP: \$40** y **SL: -\$110**, reflejando que aún se prioriza la preservación frente a un entorno desafiante. Una sola pérdida exige múltiples días ganadores para compensarse, por lo que la relación riesgo/beneficio sigue siendo débil. Esta estrategia deberá ser monitoreada de cerca para evitar seguir acumulando pérdidas innecesarias.

En contraste, **las estrategias de media mañana** (10:30, 11:00 y 11:30) siguen mostrando solidez, tanto en los porcentajes como en los valores absolutos. Se afianza la idea de que **la zona neutral del mercado se está concentrando cada vez más en ese rango horario**, lo que indica mantener el foco allí.

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 ODTE				 9:30 W50 ODTE				 9:40 W40 ODTE			
%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
5%	-5%	40	-110	11%	-7%	320	-170	7%	-15%	180	-330

 10:30 W40 ODTE				 11:00 W40 ODTE				 11:30 W40 ODTE			
%		\$		%		\$		%		\$	
TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL	TP	SL
9%	-12%	240	-150	8%	-14%	180	-210	19%	-7%	320	-150

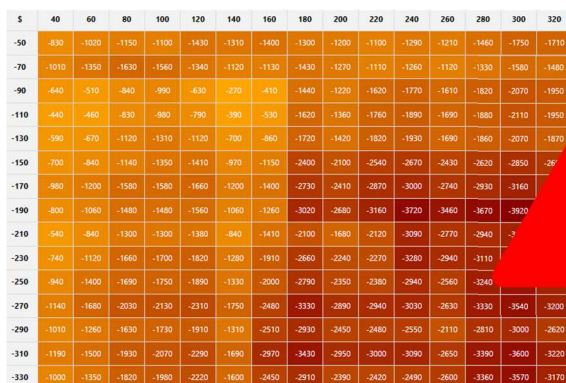
Mapas de Calor

Durante los **últimos dos meses** estuvimos revisando los mapas de calor y la cosa es bastante clara. Las estrategias de **Iron Butterflies** y **Iron Condors** de las **9:30am** no están dando resultados consistentes, sin importar qué combinación de TP y SL probemos. Todo está **rojo**. Ya lo veníamos viendo en la operativa diaria, pero ahora lo confirman los datos: hoy no hay una configuración rentable en ese horario.

En cambio, el mapa de **10:30am** es otra historia. Aparece muy **verde**, con muchas combinaciones funcionando bien. Hay estabilidad, la zona neutral está mucho más clara, y eso hace que nuestras estrategias funcionen como están pensadas.

Así que la recomendación es simple: dejemos en vigilancia (o pausa) las estrategias con horarios de **9:30am**, al menos por ahora, y enfoquemos con más decisión en **10:30am**, que es donde están las mejores probabilidades. **No es intuición, es pura estadística.**

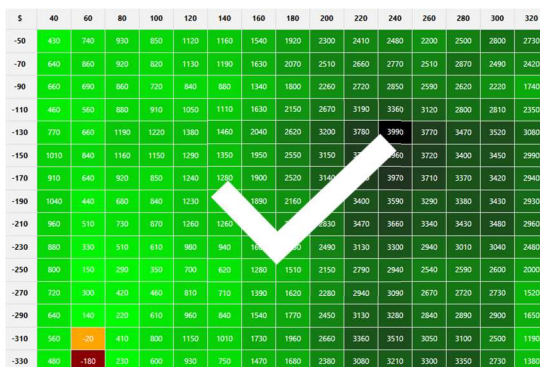
IB 9:30 w30



IB 9:30 w50



IB 10:30 w40



Nota Final:

El mercado cambia, a veces de forma sutil y otras de manera abrupta. Por eso es clave no operar en **piloto automático**. Las estrategias funcionan, pero solo si estamos dispuestos a revisarlas, ajustarlas y alinearlas con lo que los datos nos están mostrando. El **trading estadístico no busca predecir el futuro**, sino **adaptarse** con inteligencia a lo que el mercado está haciendo hoy. No se trata de reaccionar con miedo ni de forzar resultados, sino de mantenernos fieles al plan, al análisis y al proceso. La ventaja está en la **información** y la **adaptación**. Hasta la próxima semana!!!

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.