

Slippage es la **diferencia entre el precio al que esperas ejecutar una orden y el precio al que *realmente* se ejecuta.**

Dicho simple:

👉 *querías comprar/vender a un precio, pero te ejecutan a otro.*

📌 Definición clara

Slippage = precio ejecutado – precio esperado

Puede ser:

- ▲ **negativo** (peor precio para ti)
 - ▼ **positivo** (mejor precio para ti, menos común)
-

🧠 Ejemplo sencillo

Supón EUR/USD:

- Ves precio: **1.1000**
- Das BUY a mercado
- Se ejecuta en: **1.1003**

👉 **Slippage = +3 pips** (en tu contra)

Si se ejecutara en **1.0998**:

👉 **slippage positivo** (a tu favor)

🔍 ¿Por qué ocurre el slippage?

Principalmente por:

1. Alta volatilidad

- noticias
- datos macro
- rupturas rápidas

2. Baja liquidez

- fuera de horarios activos
- activos poco líquidos

3. Órdenes a mercado

- aceptas “el mejor precio disponible”
- ese precio puede cambiar en milisegundos

4. Latencia

- retraso entre:
 - tu clic / EA
 - y la llegada al broker/mercado

Slippage en trading algorítmico

En sistemas automáticos:

- el EA envía la orden
- el mercado se mueve
- el broker ejecuta al precio disponible

 el slippage **es inevitable**

 no es un bug

 es parte del coste real de operar

Por qué es importante para ML y backtesting

Si ignoras el slippage:

- tus backtests se ven **mejor de lo real**
- crees que tienes ventaja
- en real desaparece

Por eso en sistemas serios:

- se **simula slippage**
- se resta como costo adicional

- se evalúa la robustez
-

Slippage vs Spread (muy importante)

No son lo mismo:

Concepto Qué es

Spread diferencia bid–ask (siempre existe)

Slippage diferencia entre precio esperado y ejecutado (variable)

Puedes tener:

- spread bajo
 - **slippage alto** (en noticias)
-

¿Cómo se controla el slippage?

No se elimina, se **gestiona**:

- operar en timeframes mayores (1H, 4H)
 - evitar noticias de alto impacto
 - usar **órdenes limit** cuando tenga sentido
 - definir **slippage máximo permitido** en el EA
 - elegir brokers con buena ejecución
-

Frase para recordarlo

El slippage es el “costo invisible” de la velocidad del mercado.

Si quieres, el siguiente paso puede ser:

- cómo **modelar slippage en backtests**, o
- cómo **proteger un EA contra slippage excesivo**, o
- cuándo **usar market vs limit** en sistemas algorítmicos.

Tú decides.

Sí, puede pasar frecuentemente, pero no siempre, y depende mucho de cómo, cuándo y qué operes.

Vamos por partes, claro y práctico.

1 ¿Puede pasar frecuentemente el slippage?

👉 **Depende del contexto**

♦ **Poco frecuente si:**

- operas **timeframes altos** (1H, 4H, Daily)
- operas **EUR/USD, USD/JPY** (muy líquidos)
- operas **horarios activos** (Londres / NY)
- no operas noticias

♦ **Frecuente si:**

- operas **timeframes bajos** (M1, M5)
- entras con **órdenes a mercado**
- hay **alta volatilidad**
- operas **noticias económicas**
- el mercado se mueve más rápido que tu ejecución

👉 En scalping, **es casi inevitable.**

👉 En 1H como tú estás planteando, **es manejable.**

2 ¿Por qué pasa el slippage? (causa real)

🧠 **Explicación simple**

Cuando envías una orden:

- el precio **NO está fijo**
- hay un **libro de órdenes**
- el mejor precio puede desaparecer en milisegundos

Si cuando tu orden llega:

- ya no hay liquidez en ese precio
- el siguiente precio disponible es peor

👉 te ejecutan ahí.

No es (normalmente):

- un error del broker
- una trampa

Es **microestructura de mercado**.

3 ¿Qué recomiendo para que NO pase (o pase menos)?

✓ 1. Opera en timeframes adecuados

👉 **1H o mayores**

En estos:

- el slippage es pequeño comparado con el movimiento esperado
 - no destruye la estrategia
-

✓ 2. Evita noticias de alto impacto

Ejemplos:

- NFP
- CPI
- decisiones de tipos

En esos minutos:

- slippage extremo
- spreads se abren
- stops se saltan

Recomendación:

- **no operar ±15–30 min** alrededor de la noticia
-

✓ 3. Usa activos líquidos

Para Forex:

- EUR/USD
- USD/JPY
- GBP/USD

Evita:

- cruces exóticos
 - horarios muertos
-

✓ 4. Usa órdenes LIMIT cuando tenga sentido

- BUY LIMIT / SELL LIMIT
- aseguras precio
- si no hay liquidez → no entras

Trade-off:

- menos operaciones
 - pero mejor control
-

✓ 5. Define slippage máximo en el EA

En MQL5 puedes:

- rechazar la orden si el precio se mueve demasiado
- volver a intentar
- o no ejecutar

Eso protege tu sistema.

✓ 6. Modela slippage en backtest

Muy importante:

- resta X pips por trade

- o simula slippage aleatorio

Si la estrategia **sobrevive**, es robusta.

¿Se puede eliminar el slippage?

 **No.**

Ni bancos lo eliminan.

Pero sí puedes:

- hacerlo pequeño
 - hacerlo predecible
 - hacerlo irrelevante para tu horizonte
-

Resumen claro

- Sí, puede pasar frecuentemente **en ciertos contextos**
 - Pasa por **volatilidad, liquidez y latencia**
 - No se elimina, se **gestiona**
 - Con tus decisiones (1H, Forex líquido) **no es un gran problema**
-

Frase final

El slippage no mata estrategias malas.

Mata estrategias frágiles.

Si quieres, el siguiente paso puede ser:

- cómo **codificar protección contra slippage en un EA**, o
- cómo **simular slippage realista en tus backtests**.

Tú mandas.