

**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 quieras, 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?

👉 Dependiendo 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.

---

#### 4 ¿Se puede eliminar el slippage?

 No.

Ni bancos lo eliminan.

Pero sí puedes:

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

#### 5 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 quieras, el siguiente paso puede ser:

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

Tú mandas.