

Introducción al Trading Algorítmico con MT5

5 lecciones para entender los Expert Advisors, cómo leer backtests y cómo evaluar un bot antes de comprarlo.

Contenido

Lección 01	Qué es el trading algorítmico y por qué funciona
Lección 02	Cómo funciona un Expert Advisor (EA) en MT5
Lección 03	Cómo leer un backtest del Strategy Tester
Lección 04	Métricas clave: Profit Factor, Win Rate, Drawdown
Lección 05	Cómo evaluar si un bot vale la pena antes de comprarlo

Qué es el trading algorítmico y por qué funciona

El trading algorítmico es el uso de programas informáticos para ejecutar operaciones de compraventa en los mercados financieros siguiendo reglas predefinidas, sin intervención emocional del trader.

Por qué supera al trading manual

- Elimina el miedo y la euforia — las dos causas principales de pérdida en traders manuales.
- Ejecuta con precisión milimétrica: el bot no duda, no ignora su stop loss ni cierra antes de tiempo.
- Opera 24/5 sin cansancio: no pierde oportunidades por sueño, distracción o compromisos personales.
- Backtesting real: puedes probar la estrategia sobre años de historial antes de arriesgar capital.

Lo que NO es el trading algorítmico

Un bot no es una máquina de dinero infinito. Ningún algoritmo gana el 100% de las operaciones ni garantiza rentabilidad futura. Lo que sí hace es aplicar una estrategia con consistencia estadística superior a la del trading emocional.

Cómo funciona un Expert Advisor (EA) en MetaTrader 5

Un Expert Advisor (EA) es un programa en MQL5 que corre dentro de MetaTrader 5. Se adjunta a un gráfico y puede abrir, gestionar y cerrar operaciones automáticamente.

Ciclo de vida de una operación

01	Análisis Cada vela o tick, el EA evalúa las condiciones del mercado según sus indicadores y reglas internas.
02	Señal Si se cumplen los criterios configurados, el EA genera una señal de entrada BUY o SELL.
03	Validación Comprueba spread, horario, drawdown actual y otras restricciones antes de ejecutar.
04	Ejecución Abre la orden con Take Profit y Stop Loss automáticos calculados según los parámetros.
05	Gestión Monitorea la posición abierta. Puede aplicar trailing stop o cerrar anticipadamente.

Cómo leer un backtest del Strategy Tester de MT5

El Strategy Tester de MT5 ejecuta el EA sobre datos históricos reales con calidad del 100% (tick data). El resultado te dice cómo habría operado el bot en el pasado. No garantiza el futuro, pero es la mejor evidencia disponible.

Las secciones clave del informe

Campo	Qué significa
Beneficio Neto	Ganancia total del período. Expresado en USD y porcentaje sobre el depósito inicial.
Beneficio Bruto / Pérdidas Brutas	Suma de todas las operaciones ganadoras y perdedoras por separado.
Profit Factor	Ratio Beneficio Bruto / Pérdidas Brutas. Mayor a 1.5 es aceptable; sobre 3.0 es excelente.
Drawdown máximo del balance	Mayor caída registrada desde un pico de balance. Cuanto menor, mejor.
Win Rate	Porcentaje de operaciones cerradas en positivo. Un win rate alto con PF bajo puede ser trampa.
Total operaciones	Número de trades en el período. Muy pocas trades = muestra estadística insuficiente.

Métricas clave: Profit Factor, Win Rate, Drawdown

Profit Factor (PF)

= Beneficio Bruto / Pérdidas Brutas

Valor	Interpretación
< 1.0	El bot pierde dinero en total. Descártalo.
1.0 – 1.5	Marginal. Puede ser ruido estadístico.
1.5 – 3.0	Bueno. Estrategia con ventaja estadística real.
> 3.0	Excelente. Verifica que no sea overfitting (pocas operaciones).

Win Rate

Porcentaje de operaciones cerradas en positivo.

Valor	Interpretación
Win Rate alto + PF bajo	Muchas ganancias pequeñas y pocas pérdidas grandes. Riesgo.
Win Rate bajo + PF alto	Pocas ganancias pero muy grandes. Válido si el PF es sólido.
Ideal	Win rate > 60% con PF > 2.0 y muestra > 30 operaciones.

Drawdown máximo

Mayor caída del balance desde un máximo histórico.

Valor	Interpretación
< 15%	Excelente. Muy controlado.
15% – 30%	Aceptable para estrategias de rendimiento alto.
> 40%	Riesgo elevado. Requiere capital que puedas permitirte perder.

Cómo evaluar si un bot vale la pena antes de comprarlo

Antes de adquirir cualquier bot — incluyendo los de Castell Asset Group — hazle estas preguntas. Un bot legítimo puede responderlas todas.

Transparencia

- ¿Muestra backtests del Strategy Tester de MT5 con calidad del 100%?
- ¿Puedes ver los resultados mes a mes, no solo el total acumulado?
- ¿Especifica el broker, depósito, lote y período del test?

Estadísticas

- ¿El Profit Factor es mayor a 1.5 con al menos 20-30 operaciones de muestra?
- ¿El drawdown máximo es menor al 30% del capital operado?
- ¿El número de operaciones es suficiente para ser estadísticamente relevante?

Promesas realistas

- ¿Evita prometer porcentajes de ganancia fijos o garantizados?
- ¿Incluye advertencia de riesgo clara?
- ¿No ofrece "señales gratuitas" o "trading gestionado" como complemento?

Soporte y licencia

- ¿Puedes contactar al equipo directamente antes de comprar?
- ¿La licencia está vinculada a tu número de cuenta y no es genérica?
- ¿Ofrecen versión demo para backtesting?

Descarga la versión demo de nuestros bots en castellassetgroup.com y evalúalos tú mismo con el Strategy Tester.