

Como realizar un backtest en Metatrader 4

Rápido y sencillo

Una de las funcionalidades más importantes que tiene Metatrader 4 en cuanto a los robots es la prueba de estrategia o backtest, que básicamente nos permite simular cómo se hubiera comportado un robot en el pasado, y de esta forma tener una idea más clara de si estamos ante una estrategia ganadora o perdedora.

Nota: Es muy importante tener en cuenta que los resultados de un backtest son orientativos, nunca hay que tomarlos como una prueba definitiva de que estamos ante una estrategia ganadora. Pero es muy importante realizarlos para saber con certeza si estamos ante una estrategia perdedora. Lo ideal para hacer un backtest correcto es ponerse en contacto con un programador mal4. Hablaremos en detalle de todo esto en un artículo más adelante.

Lo primero que tenemos que hacer es abrir la ventana del probador de estrategias, para ello, nos vamos al menú superior **Ver->Probador de estrategias** o con la combinación de teclas **Ctrl+R.**

chivo Ver Herramientas Ayuda		
Languages	· > 2 (1) (3 Autoinaing L R A (4 (2 H L L 16 · C)· 2)·	×
Barras de herramientas	• 45 HEE 0 00 HE 144 02 WE 1991	
Barra de estado		
 Barra de conmutación de gráficos EURUZ 		
GBPU: Simbolos	Dated	
USDC Observación del Mercado	Server and S	
LICON OF Ventana de datos	SH-D	
EURCI Navegador	284-N	
EURG Terminal	Ctri+T	
GBPCI C Probador de Estrategias	201-R	
USDC 🔗 Chats	AR-M	
AUDU cape: Pantalia completa	F11	
NZDUSD 0.61765 0.61783		
AUDCAD 0.90110 0.90137		
AUDNZD 1.07411 1.07446 -		
imbolos Gráfico de tick		
0 Voluments 0 Site Williams 0 Site Wi		
AsesorExpedo V R080T_TURTLES_V01	•	v) Propiedades del esper
Asesor Experto V R0801_TURTLES_V01 Simbola EURUSD.1Late-100.0000	• •	Projiedades del esper Período: M00 Projiedades del sinbo
AsesorExperto R0801_TURTLES_V31 Simbolo EUFUSIO.11.ce+100.0001 Modelo Partes de control (un méto	K R consideration of a periodic new main potents. Ice wandedas no deben ser consideration;	✓ Propledides del experi Particulo: Particulo: M00 ✓ Spread: 30 ✓
Association Viewonida View	6 R	Projektive del esper Periode MOB v Projektive del esper Spread 30 v Projektive del sinte Spread 30 v Alter gales Gysteacción Moldine Esperio
Assor Espents v R0001_TURTLES_V01 Siedola: EURIIO.1Lai-100001 Model: Partice de central (an mite Usar fecha V De Moder visual V	N R consistent of periods never mits polene. In a workdas se obles ser consideration 15 522 * Para 2021-01 * 15 102 * Date = 2021-02 * Date	Propulsion of import Periods MOE Propulsion of import Spread Cybracolor Modern Equits
Anno Fantan I Anno Fanta V Stole ERRIG La 1000 Mole Patta de conditar ret Una facta V Bodo renal V	N	Projectodas ad espei Parisda 1000 Projectodas ad espei Parisda 1000 Projectodas ad espei Speinet 30 Cystescolor Modera Espein Modera Espei
Anno Person Pers	a A A A A A A A A A A A A A A A A A A A	Particle MB Projection of Argo Particle MB Projections of inter- Spend Particle Projections of inter- Argo price Optimization Determined Projections States Projectio



Deberemos elegir si queremos realizar la prueba sobre un asesor experto (robot) o un indicador. En este caso nos centramos en un asesor experto.

esor Experto	D. Fure up U.S. Dellar	
icador EURUSL	D, Euro vs OS Dollar	
Modelo: C. la tick	k (el método más preciso basado en todo los períod	dos menores disponibles para generar cada tick)
Usar fecha	De: 1970.01.01	Para: 1970.01.01
Modo visual		Saltar a 2019.04.09

Ahora elegimos el asesor experto con el que vamos hacer el test, para el ejemplo, vamos a usar uno de los que viene por defecto en Metatrader, el **MACD Sample**.

Asesor Experto ~	MACD Sample.ex4
Símbolo:	MACD Sample.ex4, 2005-2014, MetaQuot Software Corp.
Modelo:	
Usarfecha	
Modo visual	
gaa	
Ajusted Registro	
'ara obtener ayuda, pulse F	1

Seleccionamos el símbolo, y justo debajo de este tenemos que *elegir el Modelo o tipo de modelado de datos*, este campo es muy

The Power TRADING



importante, porque va a definir qué datos del histórico se van a tener en cuenta.

sesor Experto V	MACD Sample.ex4
Símbolo:	EURUSD, Euro vs US Dollar
Modelo:	Cada tick (el método más preciso basado en todo los períodos menores disponibles para generar cada tick)
Usar fecha	Coda tick (el método más preciso basado en todo los períodos menores disponibles para generar cada tick) Puntos de control (un método muy poco sofisticado basado en el período menor más próximo, los resultados no deben ser considerados) Sólo preciso de acertura (el método más rácido a basa de las baras va formadas sólo para Asesores Expentos que exolícitamente controlan la apertura de las barras)
Modo visual	11 Saltar a 2019.04.09 -
j usted Registro	

Nos encontramos con tres opciones:

- 1. **Cada tick**: es el método más preciso que existe, el que más se ajusta a la realidad. El robot se va a ejecutar teniendo en cuenta todas las cotizaciones existentes en el histórico. Como contra, es el más lento de todos.
- 2. **Puntos de control**: se interpolan los datos de marcos temporales menores, de esta forma se consiguen unos resultados muy aproximados a los reales, consiguiendo una mejoría importante en la velocidad del test. Es válido para las estrategias a las que no les importa en qué secuencia de ticks se desarrolla el precio.
- 3. Sólo precios de apertura: el robot sólo se va a testear en la apertura de cada vela, el resto de ticks o cotizaciones no se van a tener en cuenta. Para utilizar este método es importante que el robot esté programado específicamente para este tipo de modelado de datos. La velocidad de ejecución es altísima, es muy útil en optimizaciones con muchas combinaciones de parámetros.

Debido a la complejidad en el tema del modelado, no nos extenderemos más en este artículo, que pretende ser una guía rápida de cómo realizar una prueba de estrategia



El siguiente paso es elegir las fechas para las que queremos realizar el backtesting metatrader 4. Sino seleccionamos el check de usar fecha, por defecto, se utilizará todo el histórico disponible en nuestro metatrader 4.

Asesor Experto ~	MACD Sample.ex4					
Simbolo:	EURUSD, 1 Lot= 100.000	EUR				
Modelo:	Puntos de control (un mét	todo muy poco sofisticado basa	do en el período meno	or más próximo, los re	sultados no deben	ser considerados)
Usar fecha 🗸	De:	2015.12.22	Para:	2023.01.01		
Modo visual 🗸	[>>	Saltar a	2023.09.28 [

Ahora toca elegir si queremos hacer la prueba de estrategia en modo visual. Sino activamos esta opción, se realizará el test y nos avisará cuando haya terminado mostrando un informe con los resultados.

Cimbola	ELIDURD 11 als 100.0	ALC: UD					
Simbolo.	EURUSU, I Lot= 100,000 EUR						
Modelo:	Puntos de control (un r	nétodo muy poci	o sofisticado b	asado en el período men	or más próximo, lo	is resultados no deben	ser considerados)
Usar fecha 🗸		e: 2015.12.22		Para	2023.01.01		
Modo visual 🗸		D	>>	Saltar a	2023.09.28		

En caso de activar esta opción, al iniciar la prueba se abrirá automáticamente un gráfico donde podremos ver la simulación en vivo.

Elegimos el periodo y el spread. Por defecto en spread nos muestra Actual, de esta manera cogerá el spread que hay en ese momento para ese símbolo, es decir, si en EURUSD justo al iniciar la prueba, hay un spread de 7 puntos, se tomará dicho valor para toda la prueba de estrategia. También podemos poner el valor por defecto que consideremos.



Nota: En una prueba de estrategia el spread es fijo y no variable como ocurre en mercado real. Por eso, aconsejamos subir en un 20-30% el valor del spread que normalmente tiene nuestro bróker para ese símbolo, para ajustarnos más a la realidad, ya que en mercado real en ocasiones el spread sube de manera

		~	Propiedades del experto
~	Periodo:	H1 ~	Proviedades del símbolo
~	Spread:	Actual ~	Abrir gráfico
		Optimización	Modificar Experto

Importante tener el check de optimización desactivado, como se muestra en la imagen.

Llegamos a las propiedades del experto, al hacer click sobre este botón se nos mostrará la siguiente ventana con varias pestañas:

Pestaña Prueba



1					
	Depósito inicial:	10000 ~ USD	~		
	Posiciones:	Long & Short	\sim		
Optimiza	ación				
	Parámetro optimizado:	Balance	\sim		
	Algoritmo genético				

Seleccionaremos el depósito y la divisa, y si queremos que en nuestra prueba se abran sólo operaciones buy, sólo operaciones sell o o tanto buys como sells.

El apartado de optimización de momento no nos afecta.



Pestaña Parámetros de Entrada

Como podemos ver se muestran los parámetros de entrada para el EA y cuatro columnas, de las cuales solamente tendremos en cuenta la



primera, la de Valor. El resto Start, Paso y Stop afectan solamente a optimizaciones.

Tan sólo nos queda aceptar y darle a iniciar.

Una vez haya terminado, nos saldrá un informe con los resultados.

Barras en el historial	1103	Licks modelados	398729	Calidad del modelado	90.00
Errores de desalineación de gráficos	0				
Depósito inicial	10000.00			Spread	Actual (
Beneficio neto total	2536.00	Beneficio bruto	2536.00	Pérdida bruta	-0.0
Factor de beneficio		Beneficio esperado	422.67		
Drawdown absoluto	1380.00	Drawdown máximo	2450.00 (21.05%)	Drawdown relativo	21.05% (2450.0
Total de transacciones	6	Posiciones cortas (% ganadoras)	1 (100.00%)	Posiciones largas (% ganadoras)	5 (100.005
		Transacciones rentables (% del total)	6 (100.00%)	Transacciones no rentables (% del total)	0 (0.009
	Mayor	transacción rentable	500.00	transacción no rentable	-0.0
	Media	transacción rentable	422.67	transacción no rentable	-0.
	Número máximo	ganancias consecutivas (beneficio en dinero)	6 (2536.00)	pérdidas consecutivas (pérdidas en dinero)	0 (-0.0
	Máx.	beneficio consecutivo (número de ganancias)	2536.00 (6)	pérdidas consecutivas (número de pérdidas)	-0.00 (
	Promedio	ganancias consecutivas	6	nérdidas consecutivas	

También podremos ver un gráfico con la curva de beneficios.



Con esto es suficiente para empezar a realizar vuestras primeras pruebas de estrategia o **backtesting ea mt4**.