

Divergencia: Qué es y cómo controlarla con la nueva sección Divergencia de Inversores

Darwinex Zero ha habilitado una nueva sección en la plataforma: Divergencia de Inversores. Desde esta nueva página puedes ver, orden por orden, la diferencia entre el precio al que tú operas y el precio al que se replica a los inversores.

Si nunca has oído hablar de la divergencia, este artículo te explica qué es, por qué se produce y qué hacer si la tuya es más alta de lo que debería.

Qué es la divergencia

La divergencia es la diferencia entre el precio al que ejecutas en tu cuenta de trading (cuenta de señales) y el precio al que ejecuta el inversor en tu DARWIN.

Recuerda, **esta divergencia ya está incluida en el gráfico de retorno de tu DARWIN.**

Minimizar esa diferencia es clave si quieres gestionar capital a gran escala. Cuanta más divergencia, menos capacidad tendrá el DARWIN para atraer capital inversor.

Por qué se produce

Una réplica idéntica al 100% no es posible. Hay dos causas:

- **Latencia.** Desde que ejecutas una orden hasta que el motor la replica en las cuentas de tus inversores pasan milisegundos. En momentos de alta volatilidad o publicaciones macro, el precio puede moverse varios pips en esa fracción de segundo.
- **Volumen de los inversores (slippage).** Es el factor que más pesa cuando gestionas más capital. Si tú operas 0,1 lotes, el mercado te da contrapartida instantánea. Si tus inversores agregan 50 lotes en la misma orden, el broker tiene que fragmentarla en varios fills, y el precio medio de ejecución empeora.

La divergencia puede ser negativa (el inversor entra a peor precio que tú) o positiva (el inversor entra a un precio mejor). Lo importante es vigilar la negativa, porque es la que erosiona la rentabilidad real de quien invierte en tu DARWIN.

Cuándo es un problema

La divergencia es un problema cuando es negativa y supera el -0,2% mensual. Si tu DARWIN llega a ese punto, es una señal de alerta clara.

Este tipo de divergencia negativa sistemática suele aparecer cuando el volumen agregado de las órdenes de réplica supera el millón de euros o dólares. Cuanto más capital gestionas, más importante se vuelve controlarla.

La divergencia está ligada a la Capacidad (Cp) de tu estrategia: cuánto capital puedes absorber antes de que el deslizamiento empiece a destruir el rendimiento de tus inversores. Si la divergencia real supera la divergencia máxima tolerable de tu DARWIN, la Capacidad Usada se dispara hacia el 100% y, para proteger a los inversores que ya confían en ti, tu DARWIN se cierra temporalmente a nuevas compras.

Qué encuentras en la nueva sección Divergencia de Inversores

La nueva sección te ofrece múltiples datos para diagnosticar tu ejecución.

Puedes descargar un CSV con hasta 12 meses de histórico de tus órdenes frente a las de tus inversores: latencia, volumen, precios y divergencia de cada operación.

Te sirve para cruzar tus horarios de trading con tus peores divergencias, por ejemplo si se concentran siempre a horas "en punto" como las 14:00:00.

Qué hacer si tu divergencia es alta

Si detectas una divergencia negativa por encima del -0,2% mensual, hay medidas concretas que puedes tomar:

- **Evita operar justo "en punto".** Si tu sistema entra al inicio exacto de una vela, compites con miles de algoritmos en el mismo milisegundo. Un retraso de 5 segundos en Forex, o de 1-2 segundos en futuros, suele bastar para evitar la congestión.

- **Fracciona tus órdenes grandes.** Divide una orden en varias porciones más pequeñas, separadas por unos segundos, sin cambiar tu riesgo total. Si operas en el lote mínimo, esto requiere primero aumentar el equity de tu cuenta.
- **Vigila tu latencia.** Es un indicador temprano. Si ves picos recurrentes al inicio de las sesiones europea o americana, o en publicaciones macro, actúa antes de que la divergencia lo confirme.
- **Descarga tu CSV y busca patrones.** Compara tu divergencia por franja horaria, por activo y por tipo de orden (apertura o cierre).

Preguntas frecuentes

¿Divergencia es lo mismo que slippage? No exactamente. El slippage es una de las dos causas de la divergencia, junto con la latencia. La divergencia es la métrica que mide el resultado final de ambos efectos combinados.

¿Una divergencia positiva es mala? No. Significa que el inversor entró a mejor precio que tú. No es algo que debas perseguir, pero tampoco es un problema.

¿Dónde veo mi divergencia? En Inversores > Divergencia, dentro de tu plataforma de Darwinex Zero.

¿Qué pasa si no hago nada? Si la divergencia negativa se mantiene por encima del -0,2% mensual, la Capacidad Usada de tu DARWIN sube y se puede cerrar temporalmente a nuevos inversores.

Gracias por leernos,
Darwinex Zero

El contenido de este artículo es meramente informativo y no debe interpretarse como asesoramiento financiero y/o de inversión.