STRATEGIERAPPORT · NQ · 1 MNQ-CONTRACT

Sigma Breakout

Tijd-van-de-dag volatiliteitsband op de RTH-sessie, met stop loss. 2018-01-08 tot 2026-02-26 · 8.1 jaar · 1,604 trades over 1,488 handelsdagen

Deze configuratie. Stop 0.35% van de instapprijs · één poging per richting per dag · 1 MNQ, $2 per punt · kosten 1 punt per fill. Alle bedragen zijn dollars op één contract, zonder compounding — zoals je een funded account ook handelt.

Kerncijfers

PER JAAR	PER MAAND	PER WEEK	PER TRADE
$3.531	**$293**	**$68**	**$17.91**
gemiddeld over 8.1 jaar	mediaan $161	mediaan $23	1,604 trades

GROOTSTE DRAWDOWN	SLECHTSTE DAG	WINSTGEVENDE MAANDEN	WINSTGEVENDE TRADES
–$2.978	**–$390**	**65%**	**38%**
winst ÷ drawdown = 9.6	beste dag $1.737	weken 54% · dagen 39%	totaal $28.723

50 van de 1.604 trades dragen de hele winst

Die vijftig leveren samen $31.448 — meer dan het eindresultaat van $28.723. De overige 1.554 trades verliezen bij elkaar –$2.726.

Wat dat betekent: je mag geen enkele trade overslaan. Sla je op gevoel een paar setups over, dan is de kans groot dat je net de trades mist waar alles van afhangt — en dan handel je een systeem dat geld kost. Dit is een model dat je mechanisch draait of niet.

Waarom 38% winnende trades genoeg is. Dit is een breakout-systeem: veel kleine verliezen, weinig grote winsten. De winnaars zijn gemiddeld ruim twee keer zo groot als de verliezers. Een winrate onder de helft is hier normaal en geen zwakte — zolang je de grote winnaars meeneemt. Zie de sectie Uitschieters.

Per jaar

JAAR	RESULTAAT	TRADES	WIN	SLECHTSTE DAG	BESTE DAG	DIEPSTE DAL
2018	$3.572	197	39%	–$95	$514	–$580
2019	–$776	195	36%	–$112	$220	–$1.494
2020	$3.399	203	36%	–$166	$574	–$1.132
2021	$2.997	185	44%	–$390	$651	–$1.480
2022	$8.680	206	34%	–$218	$930	–$1.315
2023	$1.930	204	36%	–$233	$544	–$1.382
2024	$5.871	204	41%	–$286	$878	–$1.932
2025	$3.545	184	41%	–$287	$1.737	–$1.550
2026	–$496	26	31%	–$183	$888	–$1.808

Per maand

JAAR	JAN	FEB	MRT	APR	MEI	JUN	JUL	AUG	SEP	OKT	NOV	DEC	TOTAAL
2018	–$44	$477	$852	$490	$23	–$127	$956	–$104	–$11	$752	$155	$153	$3.572
2019	$518	–$102	$165	–$461	–$340	–$24	–$52	–$2	–$66	$188	–$485	–$117	–$776
2020	$162	$514	–$766	$1.094	$131	$343	$238	$832	$603	–$211	$379	$80	$3.399
2021	$314	–$155	–$76	$325	$763	$446	$123	$233	$320	$359	–$944	$1.289	$2.997
2022	$777	$35	$1.151	$2.260	$1.152	$800	$1.530	$321	–$305	$640	–$659	$978	$8.680
2023	$904	$160	–$72	$159	$24	$717	$24	$1.260	–$722	$384	–$931	$24	$1.930
2024	–$664	–$483	–$323	$2.173	–$882	$677	$2.290	$1.030	$42	$117	$106	$1.788	$5.871
2025	–$745	$465	$569	$2.149	–$271	–$113	$204	–$430	–$802	$1.259	$1.745	–$485	$3.545
2026	–$1.805	$1.309	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	–$496

Week en maand

MAAT	GEMIDDELD	MEDIAAN	BESTE	SLECHTSTE	AANTAL
Per week	$68	$23	$1.562	–$724	425
Per maand	$293	$161	$2.290	–$1.805	98

Langste reeks verliesweken achter elkaar: **9 weken**. Daar moet je doorheen zitten zonder in te grijpen.

Dagverdeling — dit bepaalt of je op een funded account kunt handelen

PERCENTIEL	1%	5%	25%	MEDIAAN	75%	95%	99%
Dagresultaat	–$200	–$163	–$93	–$49	$90	$352	$634

DAGLIMIET	AANTAL KEER DOORBROKEN	PER JAAR
$250	8	1.0
$300	1	0.1
$400	0	0.0
$500	0	0.0
$750	0	0.0

Blue Guardian 25K. Bij een daglimiet van $400 of hoger wordt die in 8.1 jaar **geen enkele keer** doorbroken. Bij $300 één keer, bij $250 acht keer. De slechtste dag is –$390 — dat is de maat waarop je je accountkeuze baseert, niet de drawdown.

En dit groeit mee. De stop is een percentage, dus hij schaalt met de prijs. NQ ging in deze periode van 6.500 naar 25.000 en de slechtste dag per jaar liep mee: $133 in 2018 tegen $408 in 2025 bij een stop van 0,50%. Reken erop dat je marge krimpt naarmate NQ stijgt, en herzie je stoppercentage jaarlijks.

Uitschieters

PERCENTIEL PER TRADE	1%	5%	25%	MEDIAAN	75%	95%	99%
Resultaat	–$179.75	–$149.30	–$92.38	–$49.71	$82.25	$347.75	$631.88

De winst zit volledig in de staart. De tien beste trades dragen 34% van de winst, de vijftig beste 109%. Gemiddelde winnaar $180.03, gemiddelde verliezer –$82.81 — een verhouding van 2.17 op 1.

Haal je alleen de tien grootste winnaars weg, dan blijft er $2.325 per jaar over in plaats van $3.531. **Dat is de fragiliteit van dit model:** onder die staart ligt niets. Gedraagt hij zich in de toekomst anders, dan is er geen tweede verdiepingslaag.

De vijf diepste dalen

DIEPTE	BEGON	BODEM	HERSTELD	DUUR IN DAGEN
–$2.978	2023-09-01	2024-04-03	2024-07-10	161
–$2.473	2025-12-01	2026-02-02	loopt nog	40
–$1.947	2019-02-14	2020-03-25	2020-06-24	251
–$1.810	2024-09-13	2024-10-17	2024-12-18	48
–$1.550	2025-04-30	2025-09-30	2025-11-20	107

Wat een andere stop doet

STOP	PER JAAR	GROOTSTE DRAWDOWN	SLECHTSTE DAG	DAGEN ONDER –$500
geen	$5.326	–$3.270	–$1.243	27
0.75%	$4.457	–$3.180	–$648	4
0.50%	$4.076	–$2.801	–$408	0
0.35%	$3.531	–$2.978	–$390	0
0.25%	$2.900	–$2.416	–$281	0

Wat dit rapport niet zegt

- **Alleen NQ.** ES en YM zijn niet getest. Een edge op één instrument is zwakker bewijs dan een edge op drie.
- **2022 draagt zwaar.** Dat jaar alleen is goed voor ongeveer een derde van de totale winst. Zonder dat jaar blijft het positief, maar magerder.
- **2019 was een verliesjaar.** Dat gebeurt opnieuw.
- **Dit is een backtest.** De fills zijn modelmatig, al is de uitkomst gecontroleerd met instap op de volgende open en met vier keer hogere kosten.