DAS NY LIQUIDITY MODEL · V3.2 · DER HANDELSTAG, DER REIHE NACH

Das NY Liquidity Model

Ein Instrument, eine Session, ein Muster. Das System beobachtet die ersten Stunden der New Yorker Kassasitzung im Nasdaq-100-Future und handelt ein einziges Ereignis: einen Raid auf ein Übernacht-Liquiditätslevel, gefolgt von einem Fair Value Gap in Tagesrichtung. Was folgt, ist das vollständige Regelwerk der Version 3.2, validiert am 5. November 2026.

01	**Richtung**	Zwei Lesungen müssen übereinstimmen, bevor gehandelt wird: die Pre-Market-Bewegung von 07:00 bis 09:30 New Yorker Zeit und die Farbe der Kerze von 09:30 bis 10:00. Widersprechen sie sich, ist der Tag aus. Im Testjahr hat allein dieser Filter einen Profit Factor von 1.4 von einem von 2.1 getrennt.
02	**Levels**	Ab 09:30 beobachtet das System sechs unberührte Levels: Asia-Hoch und -Tief (20:00 bis 00:00), London-Hoch und -Tief (02:00 bis 05:00) und Vortageshoch und -tief.
03	**Raid**	Eine 5-Minuten-Kerze, die durch eines dieser Levels handelt, ist ein Raid. Ein Raid gegen die Tagesrichtung bereitet eine Umkehr vor, ein Raid mit der Richtung eine Fortsetzung. Beides wird gehandelt, nur in Tagesrichtung.
04	**Einstieg**	Zwischen 10:00 und 12:00 löst das erste 5-Minuten-Fair-Value-Gap nach dem Raid in Tagesrichtung eine Market-Order zum Kerzenschluss aus. Der Raid verfällt nach 18 Kerzen ohne Gap.
05	**Stop**	Jenseits des Extrems des Sweeps (Umkehr) oder der Drei-Kerzen-Formation (Fortsetzung), plus vier Ticks. Ein Setup mit mehr als 150 Punkten Risiko wird übersprungen.
06	**Ziel**	Das nächste unberührte Liquiditätslevel, wenn es mindestens 1.5 R bietet; sonst das Doppelte des Risikos. Bei plus einem R geht der Stop auf Break-even.
07	**Zeit**	Ein Trade, der nach 60 Minuten noch unter dem Einstieg liegt, wird geschlossen. Nichts wird über 15:55 New Yorker Zeit gehalten, nichts über Nacht.
08	**Tageslimits**	Höchstens drei Trades pro Tag, Schluss nach zwei Gewinnern, Schluss nach 300 $ Tagesverlust pro Micro-Kontrakt.

Zwölf Monate auf NAS100-5-Minuten-Daten

Trades	87
Profit Factor	2.14
Nettoergebnis pro Micro-Kontrakt	+4 881 $
Gewinntrades	30 %
Durchschnittlicher Trade	+0.28 R

Wie die 87 Trades endeten

Zeit-Exit	23
Stop-Loss	20
Break-even-Stop	19
Ziel	13
Schluss um 15:55	12

Simulator-Zahlen, konservative Füllungen: liegen Stop und Ziel in derselben Kerze, zählt der Stop zuerst; ein Tick Slippage pro Seite; 1.20 $ Kommission pro Round Trip. Der

Algorex Trading Solutions · Zürich · Für den eigenen Gebrauch. Keine Anlageberatung; der Handel mit Futures und CFDs – auch durch birgt ein hohes Verlustrisiko.

Grösster Drawdown	573 $
Längste Verlustserie	8 Trades
Monate positiv	9 von 13
Schlechtester Monat	−298 $
Beide Halbjahre positiv	+2 738 $ und +2 143 $

TradingView-Deep-Backtest derselben Version auf MNQ1! (Oktober 2025 bis November 2026) zeigt 83 Trades, Profit Factor 1.86, +3 954 $ und einen Drawdown von 830 $. Die beiden Engines arbeiten mit verschiedenen Datenfeeds und Füllmodellen; beide stehen absichtlich hier.