

MS-7D-HOLD-WINDOW-BACKTEST-1 — Result Report

Datum: 2026-06-04 (~19:30 UTC) **Modus:** Read-only Backtest mit 7-Tage-Hold-Window auf identische 646 MS-TRADE_CANDIDATEs **Datenquelle:** Binance Public Spot API · **5-min OHLCV mit Pagination** · 7 d Window pro Candidate **Operator-Direktive:** Keine Coin-Allowlist/Denylist · nur Stablecoin/Peg-Block · 7d statt 4h

1. Executive Summary

Das 7-Tage-Window enthüllt die wahre Performance der MS-Strategien — sie ist deutlich schlechter als der 4h-Window suggerierte. Der 4h-Window hatte 90 % TIMEOUTs zu Mark-to-Market geschlossen — viele dieser MtM-Werte standen bei hohem MFE, das in den Folgetagen umkippte.

Metric	4h-Window	7d-Window	Δ
TP-Hits	14 (2.2 %)	169 (27.0 %)	+155
SL-Hits	50 (8.0 %)	388 (62.0 %)	+338
Timeouts	582 (89.8 %)	69 (11.0 %)	-513
Win-Rate	38.2 %	30.5 %	-7.7 pp
Expectancy	-0.31 %	-1.56 %	5× schlechter
Profit Factor	0.819	0.656	schlechter
Total Net %	-196 %	-978 %	5× schlechter
Timeout-Rate	89.8 %	11.0 %	-78.8 pp

Kern-Ergebnis: Das 4h-Window war eine **systematische Schönfärberei**. Die wahre Win-Rate ist 30.5 %, die wahre Edge ist klar negativ (-1.56 % je Trade netto). **MS-Live bleibt deutlich NO-GO.**

2. Daten + Methodik

Item	Wert
Candidates verarbeitet	646
OHLCV-Fetches erfolgreich	646 (100 %)
Window pro Candidate	7 Tage = 168 h
Bar-Interval	5 min (paginated, max 5 pages × 1000 bars)
Total Backtest-Laufzeit	341 s
Datenquelle	Binance Public Spot
Stablecoin-Block aktiv (RAW)	ja (20 Candidates blockiert)
Cooldown-Block (POST-RECON)	SYM 120 min + SYMSTRAT 360 min
Fee-Modell	TP/SL: 0.3 % · TIMEOUT_7D: 0.2 %
SL-vor-TP bei gleichem Bar	konservativ SL-HIT

3. Outcome-Migration 4h → 7d

4h-Outcome	→ 7d-Outcome	Count
TIMEOUT	→ SL	338
TIMEOUT	→ TP	155
TIMEOUT	→ TIMEOUT_7D	69
SL	→ SL	50
TP	→ TP	14

Was passiert mit den 582 4h-TIMEOUTs in 7d-Sicht? - 58 % (338) kippen zu SL — die Position hätte SL gerissen - 27 % (155) schaffen es zu TP - 12 % (69) bleiben TIMEOUT auch nach 7d (sehr drift-arme Symbole wie U/USDT)

Bei einer hypothetischen Live-Execution mit 7-Tage-Hold wären die meisten "scheinbar profitable" 4h-MtM-Positionen tatsächlich

Verluste geworden.

4. Per-Strategy Ergebnisse – RAW (nur Stablecoin-Block)

Strategy	N	WR	Avg-Win %	Avg-Loss %	Exp %	PF	TO %	Verdict
trend_follow	600	31.2 %	+6.71	-4.85	-1.44	0.68	9.2 %	NO_GO
breakout	23	4.3 %	+9.47	-6.43	-5.96	0.13	60.9 %	NO_GO
volatility_sweep	3	100.0 %	+8.74	—	+8.44	∞	0.0 %	DEFER (N=3)
mean_reversion	0	—	—	—	—	—	—	NO_DATA
vwap_mean_reversion	0	—	—	—	—	—	—	NO_DATA
oversold_bounce	0	—	—	—	—	—	—	NO_DATA

trend_follow liefert über 600 Trades hinweg ein klares Negativ-Ergebnis. **breakout** ist mit nur 23 Trades zu klein, aber 4 % Win-Rate ist katastrophal. **volatility_sweep** N=3 → nicht aussagekräftig.

5. Per-Strategy Ergebnisse – POST-RECON (Dedup + Stablecoin)

Dedup-Stats unverändert (gleiche Kandidaten, gleiche Regeln): - Stablecoin-Block: 20 - SYM-120m-Cooldown: 413 - SYMSTRAT-360m-Cooldown: 144 - Kept: **69**

Strategy	N	WR	Exp %	PF	Verdict
trend_follow	67	32.8 %	-0.97	0.77	DEFER (N<100)
breakout	1	0.0 %	-3.36	0.0	DEFER
volatility_sweep	1	100.0 %	+8.72	∞	DEFER

Selbst Dedup rettet die Edge nicht.

6. Per-Symbol Analyse – 4h vs 7d (Top-15)

(Nur Analyse pro Operator-Vorgabe, KEINE Allowlist/Denylist-Empfehlung)

Symbol	4h N	4h Total	4h WR	7d N	7d Total	7d WR	7d TP	7d SL	7d TO
TON/USDT	45	+96.14 %	75.6 %	45	+155.18 %	82.2 %	37	8	0
WLD/USDT	42	+86.69 %	59.5 %	42	+341.62 %	54.8 %	22	16	4
MEME/USDT	49	+41.47 %	61.2 %	49	+11.80 %	67.3 %	12	13	24
HBAR/USDT	39	+31.99 %	59.0 %	39	-136.69 %	17.9 %	7	32	0
ICP/USDT	41	+2.53 %	56.1 %	41	-50.17 %	43.9 %	18	23	0
FET/USDT	90	-18.84 %	42.2 %	90	-98.83 %	30.0 %	27	63	0
XLM/USDT	36	-11.88 %	27.8 %	36	-294.76 %	8.3 %	3	29	4
NEAR/USDT	36	-1.05 %	52.8 %	36	-221.12 %	5.6 %	2	34	0
XPL/USDT	37	-115.96 %	5.4 %	37	-251.42 %	0.0 %	0	37	0
POL/USDT	29	-12.19 %	10.3 %	29	-6.27 %	48.3 %	14	15	0
INJ/USDT	26	-22.11 %	26.9 %	26	-71.30 %	30.8 %	8	4	14
WLF/USDT	24	-64.46 %	0.0 %	24	-61.75 %	0.0 %	0	8	16
ENA/USDT	20	-137.75 %	0.0 %	20	-199.31 %	0.0 %	0	20	0
TRUMP/USDT	19	-32.22 %	0.0 %	19	-57.59 %	0.0 %	0	19	0
ALGO/USDT	16	+17.75 %	43.8 %	16	-87.75 %	0.0 %	0	16	0

Per-Symbol Beobachtungen (rein deskriptiv)

Pattern	Symbole
4h positiv & 7d noch positiver	TON (+96→+155), WLD (+87→+342)
4h positiv & 7d deutlich schwächer	MEME (+41→+12), HBAR (+32→-137), ICP (+3→-50), ALGO (+18→-88)

4h grenzwertig & 7d klar negativ	NEAR (-1→-221), XLM (-12→-295), FET (-19→-99)
4h negativ & 7d noch negativer	XPL (-116→-251), ENA (-138→-199), TRUMP (-32→-58), WLFI (-64→-62)
7d besser als 4h	TON, WLD, POL (-12→-6), MEME etwas

→ Längere Hold-Zeit ist **strukturell ungünstig** außer für ganz wenige Symbole. Aber selbst die Pattern-Stabilität von TON/WLD reicht nicht für eine harte Empfehlung (siehe MS-BACKTEST-RESULT-VERIFY-1 Cluster-Bootstrap P(loss) TON 9.5 % / WLD 19.4 %).

7. Regime-Slicing 7d (RAW)

Regime	N	WR	Exp %	PF
STRONG_TREND	351	33.6 %	-1.30	0.71
WEAK_TREND	272	26.5 %	-1.83	0.61
RANGE	3	100.0 %	+8.44	∞

WEAK_TREND ist im 7d-Window **schwächer** als STRONG_TREND — vermutlich weil WEAK_TREND-Bewegungen häufiger drehen und SL ziehen.

8. Timeout-Rate Vergleich

Variante	4h TO %	7d TO %	Δ
RAW total	89.8 %	11.0 %	-78.8 pp
POST_RECON total	88.4 %	11.0 %	-77.4 pp

Strukturelle Auflösung: 89 % der 4h-TIMEOUTs werden im 7d-Window zu echtem TP oder SL. Das 4h-Fenster verbarg die echten Outcomes systematisch.

9. Antworten auf Operator-Fragen

Q1: Hat das 7d-Haltefenster die Edge verbessert?

NEIN. Sample-weit verschlechtert sich Total Net von -196 % auf -978 %. Win-Rate sinkt von 38.2 % auf 30.5 %. Expectancy 5x schlechter. Pro Strategy: - trend_follow: Exp -0.24 % → **-1.44 %** (~6x schlechter) - breakout: Exp -2.14 % → **-5.96 %**

Auf Symbol-Level zeigen TON (+155) und WLD (+342) eine bessere Edge im 7d-Window. **Aber das ist eine Symbol-spezifische Beobachtung, keine Strategy-Aussage** — und im Aggregat klar negativ.

Q2: Bleibt MS-Live NO-GO?

JA, sogar deutlicher als zuvor. Die Daten zeigen eindeutig: - Keine Strategy passt die Akzeptanz-Schwellen - 4h-Window war systematisch zu optimistisch - Wahre Edge ist negativ (sample-weit)

Q3: Sollte Live-Time-Stop später auf 7d angepasst werden?

Differenziert: - Argument FÜR 7d-Time-Stop: 4h-Force-Close cuttet sowohl mögliche TPs (155 verpasste) als auch mögliche SLs (338 verschluckt). 7d gibt der Strategy mehr Raum zur Auflösung. Pure-Time-Stop bei 4h würde an Realität vorbeisteuern. - **Argument GEGEN 7d-Time-Stop:** Der überwältigend grosse Teil der echten Auflösungen ist SL-Hit (62 %, vs 27 % TP). Das heisst längeres Halten verstärkt vor allem Verluste — nicht Gewinne. - **Operator-Trade-off:** Aktuelle Strategie ist nicht profitabel genug, um die "länger halten"-Frage sinnvoll zu beantworten. **Zuerst Strategy-Edge etablieren, dann Time-Stop diskutieren.** - Hinweis: TIMEOUT_7D-Rate ist 11 % — also 7d wäre für die meisten Setups genug Auflösungszeit, ein Time-Stop NACH 7d (oder noch länger) wäre redundant.

Empfehlung: Time-Stop-Wahl darf nicht im Vakuum entschieden werden. Erst nach Strategy-Quality-Fix (z.B. MS-SIGNAL-QUALITY-FILTER-1) macht Time-Stop-Tuning Sinn.

10. Bewertung gegen Akzeptanz-Schwellen

Strategy	Schwelle	Result 7d	Pass?
trend_follow (N=600)	N≥100 ✓ / WR≥35 % / Exp≥+0.3 % /	N=600 / WR=31.2 % / Exp=-1.44 % /	NO auf 3 von 4

	PF \geq 1.1	PF=0.68	
breakout (N=23)	N \geq 50	N=23	NEIN (sample zu klein)
volatility_sweep (N=3)	N \geq 30	N=3	NEIN
mean_reversion	N \geq 50	N=0	NO_DATA
vwap_mean_reversion	N \geq 50	N=0	NO_DATA
oversold_bounce	N \geq 30	N=0	NO_DATA

Verdict bleibt: NO_GO für alle 6 Strategien.

11. Boundaries

0x Bot-Code-Touch · 0x Trading-State · 0x Orders · 0x MS-Live · 0x Mainnet · 0x Env · 0x DB-Write · 0x ConfigProfile · 0x Bot/Worker-Recreate · 0x Push · 0x Roadmap-Commit.

Erstellte Dateien: - `outcomes_7d.csv` — Per-Candidate 7d-Outcomes (646 Zeilen) - `report_7d.json` — strukturiertes Aggregat - `cache_7d/` — 646 OHLCV-Snapshots (7d x 5min, ~2000 Bars je Candidate) - diese Markdown- und PDF-Files

12. STOP

7d-Backtest abgeschlossen. **Stärkster Beleg bisher**, dass die MS-Strategien nicht profitabel sind. 4h-Window-Edge war ein Mark-to-Market-Artefakt. **MS-Live bleibt NO_GO**, keine Coin-Allowlist/Denylist empfohlen.

Operator-Entscheidung erforderlich für nächste Folge-Phase (MS-SIGNAL-QUALITY-FILTER-1 / MS-LIVE-OHLCV-BACKTEST-3 mit mehr Daten / Idle).