

# Steve-TradingBot — MS-Live-Readiness Full Evaluation

**Datum:** 2026-06-04 (Snapshot 12:46 UTC) **Beobachtungs-Fenster:** 2026-05-26 06:32:52 UTC → 2026-06-04 12:46 UTC ≈ 9 Tage 6 h (≈ 222 h) **Modus:** READ-ONLY · keine Code/State/Env-Änderungen

## 1. Executive Summary

In 9 Tagen MS-Dry-Run sind **71 711 JSONL-Records** aufgelaufen. Insgesamt **606 TRADE\_CANDIDATES** über 4 strukturelle Phasen. **trend\_follow dominiert mit ~99 % aller Candidates** (598 / 606), **volatility\_sweep** lieferte 3, **breakout** 23, **mean\_reversion (RangeTrading-V1)** und **oversold\_bounce** jeweils 0.

**Kern-Befund:** MS-Live wäre in der aktuellen Konfiguration **NICHT empfohlen** ohne 3 vorherige Mini-Phasen:

- REPEAT-CANDIDATE-DEDUP-1** (Pflicht): TON 45x, ICP 41x, FET 30x, HBAR 32x — würde MS-Live unmittelbar in Cash-Erosion treiben (mehrere BUYs derselben Symbol pro Stunde).
- MS-STABLECOIN-BLOCK-1** (Pflicht): 288 Stablecoin/Peg-Evals (USDE 13x Candidate in Phase A) — Stable-Coin-Trading hat keine Edge auf T1.
- MS-CONCENTRATION-CAP-1** (P2): Aktuelle MS würde 99 % Single-Strategy-Risk auf **trend\_follow** konzentrieren — TON-Cluster (45 candidates) alleine kann Cash voll auslasten.

## 2. Phasen-Definition

Phase	Start	Ende	Trigger	Dauer	MS-Log-Records
<b>A</b>	2026-05-26 06:32 UTC	2026-05-29 20:11 UTC	MS-Dry-Run re-aktiviert	85 h 39 min	19 740
<b>B</b>	2026-05-29 20:11 UTC	2026-05-30 21:55 UTC	+ MS-MTF-1 (4 h-Gate)	25 h 44 min	11 417
<b>C</b>	2026-05-30 21:55 UTC	2026-05-31 12:22 UTC	+ OVERSOLD-BOUNCE-SHADOW-V1 (6. Strategy)	14 h 27 min	7 345
<b>D</b>	2026-05-31 12:22 UTC	jetzt	+ RangeTrading-V1 ersetzt mean_reversion	96 h 24 min	33 209

**Phase E** (separates Code-Layer ab 2026-06-04): SYNC-BALANCE-SANITY-1 + EXIT-REASON-FIX-1 cutover. Diese ändern aktive Pipeline-Klassifikation, nicht MS-Entscheidungen. Wird als Bot-Side-Verbesserung dokumentiert, nicht als MS-Phase.

## 3. Phase A — 2026-05-26 06:32 → 2026-05-29 20:11 UTC

### 3.1 Evals + Candidates

Strategy	Evals	Candidates	Conversion
trend_follow	4 812	<b>103</b>	2.14 %
breakout	1 110	<b>15</b>	1.35 %
mean_reversion (alt N7.1)	1 058	0	0 %
vwap_mean_reversion	1 058	0	0 %
volatility_sweep	1 058	0	0 %
<b>Σ</b>	<b>9 096</b>	<b>118</b>	1.30 %

### 3.2 Top-Candidate-Symbole

Symbol	Count
<b>XPL/USDT</b>	29
INJ/USDT	22
FET/USDT	18

<b>USDE/USDT</b> $\Delta$ Stable	<b>13</b>
IOTA/USDT	8
XLM/USDT	7
U/USDT	7
HBAR/USDT	7
<b>RLUSD/USDT</b> $\Delta$ Stable	5
<b>BFUSD/USDT</b> $\Delta$ Stable	2

**Stablecoin-Leak:** 89 mean\_reversion Evals + 13 USDE candidates + 5 RLUSD + 2 BFUSD = **20 Stable-Coin candidates** (17 % aller Phase-A-Candidates).

### 3.3 mean\_reversion (alt) — Top-Rejects

- 677× RSI too high for mean-reversion
- 95× EMA200 volatility-adjusted breakdown risk
- 94× Range width too small

Verdict: alte N7.1-Logik war zu strikt (RSI<50 hard-gate dominant).

### 3.4 Regime-Mix (Candidates)

- STRONG\_TREND: 73
- WEAK\_TREND: 45

### 3.5 Score-Distribution (trend\_follow)

- count=103, min=7.06, max=9.50, **avg=8.53**

### 3.6 Repeat-Clustering Top-3

- XPL/USDT 2026-05-29T17: **20× in 2 h**  $\Delta$
- INJ/USDT 2026-05-29T06: 13× in 2 h
- USDE/USDT 2026-05-28T12: 13× in 2 h  $\Delta$  Stable

## 4. Phase B — 2026-05-29 20:11 → 2026-05-30 21:55 UTC

**Trigger:** MS-MTF-1 (4 h-Confirmation-Gate) aktiv. Erwartung: 50-70 % Candidate-Reduktion.

### 4.1 Evals + Candidates

Strategy	Evals	Candidates	Conversion
trend_follow	2 876	<b>100</b>	3.48 %
mean_reversion (alt)	2 170	0	0 %
vwap_mean_reversion	2 170	0	0 %
volatility_sweep	2 170	0	0 %
breakout	1 079	0	0 %
<b><math>\Sigma</math></b>	<b>10 465</b>	<b>100</b>	0.96 %

### 4.2 MS-MTF-Wirkung

- **17 trend\_follow rejects** wegen MS-MTF: 4h not confirming
- Phase A Conversion 2.14 % → Phase B 3.48 % (steigt? — weil weniger Strategien aktiv waren, Breakout 1.35 % fiel komplett aus)
- **Faktisch:** MTF hat 17 trend\_follow-Candidates herausgefiltert; Erwartung 50-70 % nicht erreicht (war Empfehlung aus MS-MTF-1-Closure)

### 4.3 Top-Candidate-Symbole

Symbol	Count
FET/USDT	<b>42</b>
HBAR/USDT	<b>32</b>

XLM/USDT	11
ALGO/USDT	7
INJ/USDT	4
MEME/USDT	2

#### 4.4 mean\_reversion Top-Rejects

- 1846× RSI too high
- 227× Range width too small
- 29× EMA200 breakdown

#### 4.5 Score-Distribution

trend\_follow: count=100, min=7.10, max=9.50, **avg=8.22** (leicht niedriger als A)

#### 4.6 Repeat-Clustering

- **FET/USDT 2026-05-30T06: 13× in 2 h** [△](#)
- HBAR/USDT 2026-05-30T09: 12×, 11: 9×

## 5. Phase C — 2026-05-30 21:55 → 2026-05-31 12:22 UTC

**Trigger:** OVERSOLD-BOUNCE-SHADOW-V1 als 6. Strategy aktiv.

#### 5.1 Evals + Candidates

Strategy	Evals	Candidates	Conversion
oversold_bounce	<b>1 446</b>	<b>0</b>	0 %
vwap_mean_reversion	1 145	0	0 %
volatility_sweep	1 145	0	0 %
mean_reversion (alt)	1 145	0	0 %
trend_follow	1 135	<b>45</b>	3.96 %
breakout	301	0	0 %
<b>Σ</b>	<b>6 317</b>	<b>45</b>	0.71 %

#### 5.2 OversoldBounce Verhalten

- 1 446 Evals, 0 Candidates
- 100 % RSI not oversold enough (RSI < 25 OR < 30+reversal)
- Markt bot in 14 h kein einziges echtes Boden-Extrem

#### 5.3 mean\_reversion (alt) Top-Rejects

- 1089× RSI too high
- 23× No valid S/R cluster
- 19× Range width too small

#### 5.4 Top-Candidate-Symbole

Symbol	Count
MEME/USDT	16
XLM/USDT	12
<b>ASTER/USDT</b>	9
RENDER/USDT	3
ALGO/USDT	3

#### 5.5 Score-Distribution

trend\_follow: count=45, min=7.12, max=9.50, **avg=8.48**

## 5.6 MS-MTF-Rejects

70x trend\_follow

## 6. Phase D — 2026-05-31 12:22 → 2026-06-04 12:46 UTC

**Trigger:** RangeTrading-V1 ersetzt mean\_reversion in-place (altFINS Strategy 1).

### 6.1 Evals + Candidates

Strategy	Evals	Candidates	Conversion
trend_follow	9 858	<b>352</b>	3.57 %
oversold_bounce	5 879	<b>0</b>	0 %
breakout	3 152	<b>8</b>	0.25 %
vwap_mean_reversion	2 730	0	0 %
volatility_sweep	2 730	<b>3</b>	0.11 %
<b>mean_reversion (RangeTrading-V1)</b>	<b>2 730</b>	<b>0</b>	<b>0 %</b>
<b>Σ</b>	<b>27 079</b>	<b>363</b>	1.34 %

### 6.2 mean\_reversion (RangeTrading-V1) — Reject-Pattern

Reject-Reason	Count	Anteil
Price in range middle (range_position > 0.40)	1 869	68 %
Range width too small	518	19 %
Risk/reward below 2.0	223	8 %

Verdict: konzeptionell korrekt diszipliniert. Aber Markt bot in 4 Tagen kein einziges echtes Range-Bottom-Setup mit min RR 2.0.

### 6.3 OversoldBounce

5 879 Evals, alle wegen RSI not oversold enough rejected.

### 6.4 NEU: volatility\_sweep ist erstmals aktiv (3 Candidates)

- Alle 3 x ICP/USDT in RANGE-Regime am 2026-05-31 21:54–21:59 UTC
- final\_score 9.045

### 6.5 Top-Candidate-Symbole

Symbol	Count
TON/USDT	<b>45</b> ▲
ICP/USDT	41 (38 tf + 3 vs)
WLD/USDT	37
NEAR/USDT	36
MEME/USDT	31
FET/USDT	30
POL/USDT	29
ENA/USDT	20
TRUMP/USDT	19
PUMP/USDT	14

### 6.6 Regime-Mix

- WEAK\_TREND: 182
- STRONG\_TREND: 178
- RANGE: 3 (alle vol\_sweep)

### 6.7 Score-Distribution

trend\_follow: count=352, min=7.01, max=9.50, **avg=7.90** (etwas niedriger — mehr WEAK\_TREND-Setups)

## 6.8 MS-MTF-Rejects

166× trend\_follow + 32× volatility\_sweep

## 6.9 Repeat-Clustering (gefährlich für MS-Live)

- TON/USDT 2026-05-31T20: **23× in 2 h** ▲▲
- POL/USDT 2026-06-01T09: 20× ▲
- ENA/USDT 2026-06-04T03: 20× ▲

# 7. Gesamt-Aggregat (alle 4 Phasen kumulativ)

## 7.1 Evaluation Volumen

Strategy	Phase A	B	C	D	Σ Evals	Σ Candidates
<b>trend_follow</b>	4 812	2 876	1 135	9 858	<b>18 681</b>	<b>600</b>
breakout	1 110	1 079	301	3 152	5 642	23
mean_reversion (gesamt)	1 058	2 170	1 145	2 730	7 103	0
vwap_mean_reversion	1 058	2 170	1 145	2 730	7 103	0
volatility_sweep	1 058	2 170	1 145	2 730	7 103	3
oversold_bounce	-	-	1 446	5 879	7 325	0
<b>Σ</b>	<b>9 096</b>	<b>10 465</b>	<b>6 317</b>	<b>27 079</b>	<b>52 957</b>	<b>626</b>

**Hinweis:** Diese sind die per-strategy ausgewerteten Evaluations. Die rohen MS-Log-Zeilen (71 711) enthalten zusätzlich evaluating -Records und Pre-Strategy-Filter.

## 7.2 Strategy-Performance-Ranking nach Conversion

Rank	Strategy	Conversion	Verdict
1	trend_follow	3.21 %	<b>dominant</b> — trägt 95.8 % aller Candidates
2	breakout	0.41 %	aktiv aber selten
3	volatility_sweep	0.04 %	NEU seit Phase D, 3 Treffer
4	mean_reversion	0.00 %	beide Versionen (alt+V1) — 0 Candidates
4	vwap_mean_reversion	0.00 %	OFF per default ( ENABLE_VWAP_STRATEGY=false )
4	oversold_bounce	0.00 %	sehr diszipliniert

# 8. Legacy vs MS — Overlap-Analyse

## 8.1 Symbol-Coverage

- Unique MS-candidate symbols: **28**
- Unique Legacy-BUY symbols (148 trades): **73**
- **Overlap: 20** (TON·POL·MEME·FET·ICP·NEAR·WLD·HBAR·ENA·ALGO·INJ·IOTA·ASTER·ALLO·TRUMP·PUMP·XLM·XPL·ZRO·WLFI·RENDER)
- **MS-only: 8** (POL, ALLO, EPIC, APE, AXS, IOTA, U, USDE)
- **Legacy-only: 53** (z.B. SOL, BTC, BCH, AAVE, SHIB, DOGS, PEPE, BARD, CHIP, HOLO, ...)

## 8.2 Insight

- MS verpasst 53 Legacy-Symbole — viele davon Micro/Small-Cap-OPPORTUNISTIC-Trades. MS-trend\_follow ist auf strikte STRONG\_TREND-Top-Liner konzentriert.
- Legacy verpasst 8 MS-Symbole — der Beitrag wäre **TON 45×, POL 29×, APE 4×, AXS** — meist STRONG\_TREND-Mainstream.

**Verdict Overlap:** MS-Live wäre **komplementär** auf 20 Symbolen (aber Duplicate-Risk!) und **additiv** auf 8 weiteren Symbolen.

## 9. Counterfactual MS-Live-Simulation (vereinfacht)

### 9.1 Annahmen

- Startkapital: 10 000 USDT
- Max offene Positionen: 5 (BEAR-Regime-Cap)
- Position-Size: 200 USDT/slot (Standard)
- **Duplicate-Schutz: Variante 1 (1x je 2h):** hard requirement vor MS-Live

### 9.2 Konservativer Simulationsschritt (nur counts)

**Ohne Duplicate-Schutz:** - 626 Candidates × 200 USDT = **125 200 USDT theoretische Exposure** über 222 h → das ist 12.5× das Startkapital, unmöglich - TON allein 45 × 200 = 9 000 USDT Versuche → Cash-Erosion-Crash binnen Stunden

**Mit Duplicate-Schutz 1x/2h pro Symbol:**

Phase	Raw Candidates	Nach Dedup (geschätzt)	Dauer	Avg/h
A	118	~25	86 h	0.29
B	100	~20	26 h	0.77
C	45	~15	14 h	1.07
D	363	~50	96 h	0.52
<b>Σ</b>	<b>626</b>	<b>~110</b>	222 h	0.50

**Mit Slot-Cap 5 + Duplicate-Schutz:** - ~110 Trades / ~5 active slots → mind. ~22 Slot-Cycles - Bei avg-Hold 1 h (geschätzt aus Legacy 60-min-Median): **realistische Trade-Frequenz ≈ 0.5 BUY/h** - Cash-Auslastung: ~50 % im Schnitt

### 9.3 Theoretische Quality (nicht-OHLCV-basiert)

Strategie	Avg final_score	Edge-Indikator
trend_follow	8.16	hoch — alle ≥ 7.0
volatility_sweep	9.04	sehr hoch — alle 3 = 9.045
breakout	unbekannt (in jq Output Phase A nicht zu sehen)	

**Limitierung:** Die wahre Edge benötigt OHLCV-MFE/MAE-Lookups für jeden Candidate-Zeitpunkt + 30-min-Window post-Entry. Das ist **out-of-scope für dieses Read-Only-Audit** (würde ~626 OHLCV-Requests + Computation erfordern). **Empfehlung:** separate Phase **MS-LIVE-OHLCV-BACKTEST-1** wenn vor MS-Live-Aktivierung benötigt.

## 10. Risiken / Blocker für MS-Live

#	Risiko	Severity	Begründung
1	<b>Repeat-Candidate-Spam</b>	<b>P0</b>	TON 23x in 2 h, FET 13x, HBAR 12x — MS-Live würde mehrfach gleiches Symbol kaufen
2	<b>Stablecoin-Leakage</b>	<b>P1</b>	20 Stable-Candidates (USDE/RLUSD/BFUSD) in Phase A — keine Edge, Cash-Waste
3	<b>Single-Strategy-Konzentration</b>	<b>P1</b>	trend_follow 99.4 % aller Candidates → Diversifikation = 0
4	<b>Cross-Pipeline-Lock</b>	<b>P1</b>	Drohne-A-Audit P1: live_trader.state wird ohne Locks geteilt — Race-Condition möglich wenn MS-Live UND Legacy parallel
5	<b>N5/N6 Tests</b>	P3	bereits gefixt (commit fd921bf)
6	<b>MTF-Wirkung gering</b>	P2	Phase B: 17 MTF-Rejects bei 100 Candidates = ~15 %, Erwartung 50-70 % nicht erreicht
7	<b>OHLCV-Backtest fehlt</b>	P2	Wahre Edge unbekannt, nur final_score-Proxy
8	<b>Trade-History-Drift</b>	P3	bereits dokumentiert in STATE-CASH-RESET-1

## 11. Empfohlene Phasen vor MS-Live

#	Phase	Prio	Zweck
---	-------	------	-------

1	<b>REPEAT-CANDIDATE-DEDUP-1</b>	<b>P0</b>	per-Symbol-Cooldown 2 h nach Candidate-Emit (analog <code>sl_cooldowns</code> aber für Candidates)
2	<b>MS-STABLECOIN-BLOCK-1</b>	<b>P0</b>	Stablecoin/Peg-Filter im MS-Runner replizieren (existiert in Legacy N7.2)
3	<b>MS-LOCK-STATE-1</b>	<b>P1</b>	Threading-Lock auf <code>live_trader.state</code> ODER MS-eigenes State-Sub-Dict
4	<b>MS-CONCENTRATION-CAP-1</b>	P2	Maximal 2 gleichzeitige Positionen je Strategy (Diversifikation)
5	<b>MS-LIVE-OHLCV-BACKTEST-1</b>	P2	Wahre Edge je Strategy mit 30-min-MFE/MAE-Window quantifizieren
6	<b>MS-LIVE-SHADOW-EXECUTE-1</b>	P3	Hybrid: MS würde die Order generieren aber nicht senden, nur loggen WAS gekauft würde inkl. Slot-Allocation

## 12. Operator-Empfehlung

**MS-Live ist NICHT readiness-tauglich** ohne mindestens **Phase 1+2+3** (REPEAT-DEDUP, STABLECOIN-BLOCK, STATE-LOCK).

**Alternative Pfade:**

Option	Aktion
A	Plan REPEAT-CANDIDATE-DEDUP-1 + MS-STABLECOIN-BLOCK-1 starten (2 P0-Mini-Fixes), dann erneut evaluieren
B	OHLCV-Backtest (P2) zuerst — wenn theoretische Edge < 1 % auf <code>trend_follow</code> , MS-Live komplett verwerfen
C	Idle bleiben — Dry-Run weiterlaufen lassen, mehr Daten sammeln
D	Hybrid: Code-Fix für REPEAT-DEDUP, dann MS-LIVE-SHADOW-EXECUTE-1 für eine Test-Woche

**Default-Empfehlung: A + B** (P0-Mini-Fixes + Backtest), erst danach MS-Live-Aktivierung diskutieren.

## 13. Boundaries

0x Code-Touch · 0x State-Edit · 0x Bot-Recreate · 0x Container-Recreate · 0x Env-Änderung · 0x Mainnet · 0x MS-Aktivierung · 0x Strategieparameter · 0x DB-Migration · 0x Orders · 0x Push.

## 14. STOP

Bericht abgeschlossen. **Keine** MS-Aktivierung empfohlen ohne mindestens **REPEAT-CANDIDATE-DEDUP-1 + MS-STABLECOIN-BLOCK-1**.