

# MS-STRATEGY-REPLAY-20COIN-BACKTEST-1 — Result

**Datum:** 2026-06-05 (~00:50 UTC) **Modus:** Read-only objektive 180-Tage-Replay-Validierung der MS-MTF-D-Protected-Strategie  
**Universum:** 20 Coins nach Binance Spot 24h Volumen, Stablecoins/Peg ausgeschlossen **Zeitraum:** 2025-12-08 → 2026-06-04 (180 d) **Walk-Forward:** Train 60 / Validation 20 / Test 20 (chronologisch)

## 1. Executive Summary

**Wichtiges Reversal-Finding:** Die ursprüngliche 7-Tage-Walk-Forward-Validation hat ein **zu optimistisches Bild** geliefert. Auf 180 Tagen objektivem 20-Coin-Universum mit identischer Konfiguration ist die Strategie **netto leicht negativ**.

Metric	7-Tage Validation	180-Tage Replay
N	203	<b>491</b>
WR	80 %	<b>44.5 %</b>
Expectancy	+0.29 %	<b>-0.026 %</b>
Profit Factor	1.99	<b>0.95</b>
Total Net %	+57.8	<b>-12.6</b>
Max DD	—	<b>-38.4 %</b>
Max Loss-Streak	4	<b>15</b>
Worst Day	+9.74 %	<b>-13.19 %</b>
Worst Week	—	<b>-21.78 %</b>
Bootstrap P(loss)	4.8 %	<b>64.1 %</b>

→ **MS-Live bleibt NO-GO.** Die scheinbare Edge aus dem 7-Tage-Test war ein Cherry-Pick auf günstiges Markt-Regime.

## 2. Daten + Methodik

### Coin-Universum (objektiv vor Backtest fixiert)

20 Top USDT-Pairs by Binance 24h Quote-Volume: **BTC · ETH · ZEC · SOL · WLD · BNB · XRP · NEAR · DOGE · SUI · XLM · ENA · ADA · TRX · OPN · ONDO · U · LINK · TON · FET**

### Signal-Generator (simplified trend\_follow)

Per 1h-Bar — alle Bedingungen müssen erfüllt sein: - close > EMA20 > EMA50 (bullish alignment) - close > max(highs[i-20:i]) (20-bar breakout) - RSI(14) ∈ [55, 75] (uptrend, nicht überextended) - Volume > 1.2 × 20-bar-avg (Volume-Confirmation)

SL = niedrigster low der letzten 10 Bars (Swing-Low). TP = entry + 2.5 × (entry - SL).

### MTF-D Filter

- 1h, 4h, 8h, 12h: jeweils bullish wenn `close > EMA20 > EMA50` Score ≥ 50
- Trade nur wenn ≥ 3 von 4 Timeframes bullish

### Dedup

- SYM 120 min (Symbol-only)
- SYMSTRAT 360 min (Symbol+Strategy)

### Exit-Toolkit (walk-forward-validierte Defaults)

- BE-Gain 0.8 % Trigger / 0.8 % Buffer
- Partial-Profit 1.5 % Trigger / 30 % Sell
- Trailing 2.0 % Trigger / 0.5 % Floor
- 4h Hold-Window
- Realistic Fill (gap-down at open, 1-bar delay)
- Fee 0.3 % roundtrip, 0.2 % timeout

### Filter-Counters (180d)

--	--

Filter	Count
Signals erzeugt	913
Davon MTF-D-Reject	240 (26 %)
Davon SYM-Cooldown	84
Davon SYMSTRAT-Cooldown	98
Davon ausgeführt	<b>491 (54 %)</b>

### 3. Overall-Ergebnisse

Metric	Wert
N	491
Win-Rate	44.5 %
Avg Win	+1.02 %
Avg Loss	-0.88 %
Expectancy	<b>-0.026 %</b>
Profit Factor	<b>0.95</b>
Total Net	<b>-12.55 %</b>
TP-Hits	3
SL_PROFIT	120
SL_LOSS	48
TIMEOUT	320 (65 %)
Max Drawdown	<b>-38.37 %</b>
Max Loss-Streak	<b>15 consecutive</b>
Worst Day	2026-03-10 (-13.19 %)
Worst Week	2026-W02 (-21.78 %)
Bootstrap mean	-12.43 %
Bootstrap 95 % CI	[-83.74 %, +59.04 %]
Bootstrap P(loss)	<b>64.1 %</b>

**Verdict:** Edge ist statistisch **nicht signifikant**, sogar leicht negativ. Drawdown-Profil inakzeptabel für Live.

### 4. Walk-Forward 60/20/20

Split	Window	N	WR	Exp %	PF	Total %	Max DD	Max Streak	P(loss)
<b>Train</b> (60 %)	2025-12-27 → 2026-04-15	294	44.9 %	-0.015	0.97	<b>-4.53</b>	33.1 %	15	54.3 %
<b>Validation</b> (20 %)	2026-04-15 → 2026-05-04	98	42.9 %	-0.151	0.62	<b>-14.82</b>	18.4 %	6	<b>93.5 %</b>
<b>Test</b> (20 %)	2026-05-04 → 2026-05-25	99	47.5 %	+0.069	1.13	<b>+6.80</b>	25.0 %	10	38.4 %

#### Insight

- **Train ist neutral negativ** (-4.5 %)
- **Validation kollabiert** (-14.82 %, P(loss) 93.5 %) — Strategie hat in 04/15-05/04 systemisch verloren
- **Test ist positiv** (+6.80 %) — neuestes 3-Wochen-Fenster ist günstig

→ **Strategie ist STARK regime-abhängig.** Nicht statistisch über alle Phasen robust.

#### Akzeptanz-Check

Schwelle	Test-Set	Status
PF $\geq$ 1.5	1.13	<b>X FAIL</b>
Expectancy > 0	+0.069	✓ schwach
P(loss) niedrig ( $\leq$ 5 %)	38.4 %	<b>X FAIL</b>
Kein einzelner Coin trägt Edge	siehe §5	<b>X FAIL</b> (FET +14, ENA +10)
Kein einzelner Zeitraum trägt Edge	siehe §7	<b>X FAIL</b> (12/25 +4.5 vs 03/26 -9.9)

Train/Test kein Kollaps	Train -4.5, Val -15, Test +7	grenzwertig
-------------------------	------------------------------	-------------

5 von 6 Akzeptanz-Schwellen erfüllt NICHT.

## 5. Per-Coin-Auswertung

Symbol	N	WR	Exp %	PF	Total %	SL_LOSS
<b>FET/USDT</b>	11	81.8 %	+1.28	6.60	<b>+14.09</b>	0
<b>ENA/USDT</b>	10	80.0 %	+0.98	8.74	+9.81	0
<b>SUI/USDT</b>	24	58.3 %	+0.35	1.97	+8.42	2
<b>XLM/USDT</b>	26	61.5 %	+0.23	1.53	+5.96	0
OPN/USDT	4	100 %	+1.24	∞	+4.95	1
WLD/USDT	5	60 %	+0.98	11.55	+4.88	2
NEAR/USDT	25	64 %	+0.17	1.31	+4.33	4
TON/USDT	21	61.9 %	+0.20	1.35	+4.21	2
ZEC/USDT	9	44.4 %	-0.16	0.77	-1.41	3
BTC/USDT	39	35.9 %	-0.06	0.86	-2.24	2
ETH/USDT	33	39.4 %	-0.10	0.80	-3.14	1
TRX/USDT	60	48.3 %	-0.07	0.70	-3.92	2
XRP/USDT	29	41.4 %	-0.15	0.75	-4.38	4
ADA/USDT	24	37.5 %	-0.22	0.66	-5.37	3
ONDO/USDT	23	39.1 %	-0.25	0.50	-5.75	0
BNB/USDT	50	36.0 %	-0.16	0.63	-8.14	2
DOGE/USDT	33	33.3 %	-0.26	0.55	-8.46	4
SOL/USDT	36	30.6 %	-0.33	0.55	-11.96	5
<b>LINK/USDT</b>	29	27.6 %	-0.50	0.40	<b>-14.43</b>	11

### Pattern

- **8 Coins positiv** (40 %), 11 negativ (55 %), 1 leicht negativ (5 %)
- Top-2 Gewinner FET+ENA = +24 USDT-Net — N=21 trades total
- Bottom-3 Verlierer SOL+LINK+DOGE = -34 % Net — N=98 trades
- **Edge ist KONZENTRIERT auf wenige Coins**, aber Operator-Boundary verbietet Allowlist

→ **Wichtig:** Die Strategie funktioniert auf KEINEN BTC, ETH oder anderen Mainstream-Pairs — paradox, weil das die liquidsten sind.

## 6. Per-Regime-Auswertung

Regime	N	WR	Exp %	PF	Total %
<b>RANGE</b>	261	47.9 %	<b>+0.100</b>	<b>1.31</b>	<b>+26.11</b>
WEAK_TREND	207	42.5 %	-0.145	0.77	-30.07
BULL_STRONG	23	34.8 %	-0.373	0.64	-8.59

### Striking Insight

Die Strategie funktioniert **IN RANGE-Märkten, aber NICHT in TRENDS** — obwohl sie als "trend\_follow" konzipiert ist.

- **RANGE: +26 % Total** — was paradox ist für eine Trend-Strategie
- **WEAK\_TREND: -30 % Total** — Edge ist NEGATIV im erwarteten Setup
- **BULL\_STRONG: -8.6 %** — sogar in starkem Bull-Markt schlecht

→ Möglicherweise filtert MTF-D 3-of-4 in Trends ZU AGGRESSIV (höhere TFs sind nicht synchronisiert in echten Trend-Setups) und lässt RANGE-Breakouts (False-Signals) durch.

→ **REGIME-AWARE-PARAMS-1 (P1) ist DRINGEND**, um WEAK\_TREND/BULL-Verluste zu eliminieren.

## 7. Period-Concentration

Monat	PnL %	N
2025-12 (3 d only)	+4.47 %	18
2026-01	-7.19 %	101
2026-02	-0.21 %	10
2026-03	-9.91 %	106
2026-04	+0.05 %	132
2026-05	+0.24 %	124

**Insight:** Strategie liefert in JANUAR und MÄRZ massive Verluste. Nicht durchgehend profitabel.

## 8. Vergleich zu vorherigen Backtests

Backtest	N	Window	WR	Total %	Methodik-Note
MS Protected Backtest (7d Walk-Forward)	203	3 d	80 %	+57.8	Cherry-picked, kleine Stichprobe
MS Aggressive (BE 0.5/0.3, optimistic fill)	536	7 d	94 %	+251	Overfit (BE Matrix bestätigt)
Walk-Forward Validation realistic	203 (test)	3 d	80 %	+57.8	Test-Set robust ABER kleines Sample
<b>180-Tag Replay objektives Universum (jetzt)</b>	491	180 d	45 %	-12.6	objektiv, robust statistisch

**Verdict:** Je größer Sample, je schlechter die Edge. Die ursprünglichen positiven Ergebnisse waren **Cherry-Pick auf günstige 1-Woche-Period**.

## 9. Antworten auf Operator-Fragen

### Ist MS-MTF-D-Shadow weiter sinnvoll?

**JA — als Datensammlung.** Aber **NICHT als Vorbereitung auf MS-Live in der aktuellen Form.** Shadow wäre nur sinnvoll wenn: 1. BTC-Macro-Filter ergänzt 2. Regime-Aware-Params ergänzt (RANGE-Bias entfernen oder umkehren) 3. Loss-Streak Circuit Breaker

### MS-Live weiterhin NO-GO/DEFER/GO-PLAN?

**NO-GO bestätigt.** 180-Tage objektiver Replay zeigt klar negative Edge.

### Welche weiteren Filter sind nötig?

Filter	Priorität	Begründung
<b>REGIME-AWARE-PARAMS-1</b>	<b>P0</b>	RANGE +26 % vs WEAK_TREND -30 % vs BULL_STRONG -9 %. Strategie sollte in TRENDS PAUSIERT oder anders konfiguriert werden
<b>BTC-MACRO-CONFIRMATION-1</b>	<b>P0</b>	BTC selbst hat -2.2 % Total — wenn BTC nicht trending, ist Strategie unbrauchbar
<b>LOSS-STREAK-CIRCUIT-BREAKER-1</b>	<b>P1</b>	Max-Streak 15 → strategy würde Kapital pulverisieren ohne Pause
<b>TIME-OF-DAY-EDGE-CHECK-1</b>	P2	nicht angegangen — könnte 2026-03-10 Worst-Day-Pattern zeigen
Cross-Asset-Correlation	P2	TOP-Performer FET/ENA sind korreliert → nicht echte Diversification

## 10. Operator-Empfehlung — REVIDIERT

### Verworfen

- **MS-MTF-D-PROTECTED-SHADOW-PLAN** in der aktuellen Form (P1 → DEFER)
- **MS-Live-Pilot** (P0 abgelehnt)

### Neue Reihenfolge der nächsten Phasen

#	Phase	Priorität	Aufwand
1	<b>REGIME-AWARE-PARAMS-1 — Plan</b>	<b>P0</b>	2 h
2	<b>BTC-MACRO-CONFIRMATION-1 — Plan</b>	<b>P0</b>	2 h
3	LOSS-STREAK-CIRCUIT-BREAKER-1 — Plan	P1	2 h
4	Nach P0 implementiert: 180d Replay neu	P0	4 h
5	Nur wenn Re-Replay positiv: Shadow-Plan	P2	siehe alt

## 11. Risiken / Caveats

#	Caveat	Severity
1	Simplified trend_follow weicht von Bot's echtem score_signal ab	Mittel — Indikator-Bias, aber ähnlich genug
2	1h-Resolution für Bar-Walk (statt 5min) verfälscht Trigger-Timing	Niedrig — moderate Auswirkung auf Triggers
3	Realistic-fill modellierung pessimistisch	Konservativ — kein Risiko-Hidden
4	OPN ist Newcoin (kurze History) → kleine N	Mittel — 4 trades nicht statistisch
5	Coin-Universum durch Volumen-Filter dominiert von Majors (BTC/ETH)	Niedrig — Operator-Wahl objektiv
6	MTF-D Filter mag zu Trend-feindlich sein	Hoch — siehe Regime-Result

## 12. Boundaries

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

**Erstellte Dateien:** - `universe.json` — 20-Coin-Universum mit Begründung - `all_trades.json` + `.csv` — 491 simulierte Trades - `aggregate.json` — Full Auswertung inkl. Walk-Forward - diese MD + PDF

## 13. STOP

**180-Tage Replay enthüllt: MS-Strategie ist im aktuellen Stand nicht profitabel** auf objektivem Universum. Edge war zeit- und symbol-konzentriert. **MS-Live bleibt NO-GO.** Vor Shadow-Plan: Regime-Aware + BTC-Macro Filter sind P0-Vorbedingung.