

Auswertungsbericht — Monitoring-Phase

Zeitraum: 2026-05-17 06:19 UTC → 2026-05-18 06:00 UTC **Dauer:** ~24 Stunden **Bot main.py:** uninterrupted (mehrere Code-Cutover, alle non-disruptive) **Bewertet:** 2026-05-18 06:00 UTC

1. Executive Summary

24h Live-Trading auf Binance Testnet mit aktiver Phase A1/B/C1/D + 2 Hotfix-Cutovern (SHIB-State-Drift + SL-TP-env-allowlist). **11 closed trades**, davon 2 trailing-wins, 9 SL-Closes. **Net Session-PnL: -94.12 USDT** (-0.94 % auf Starting Capital 10 000). Datensample für C2-Threshold-Kalibrierung gewachsen (567 Quality-Shadow-BUYs, stable avg 0.573, sd 0.057). **Stabilität top** (0 Tracebacks über 4 Cutover + Nightly-Run). **3 echte Bot-Bugs aufgedeckt** (Phantom-Sell-Loop, `_track_sell_failure` silent, DCA-Log-Orphans). Aktuell **0 offene Positionen, Cash 10 564 USDT** (= 10 564 – 11 Closes – 564 buys netto + Trailing-wins).

Ampel

Domäne	Status
Stabilität	🟢 grün (0 Tracebacks, 5 Cutover, Nightly-Run sauber)
Risiko	🟡 gelb (Phase D BEAR-Block live verifiziert, ABER Phantom-Sell-Loop ist P0-Risk im Mainnet)
Performance	🟡 gelb (-0.94 %/24h, Trailing fired 2× erfolgreich, aber 9 SL-Closes)
Datenqualität	🟠 orange (<code>entry_price</code> -Semantik weiter unscharf, <code>dca_log</code> Orphans, aber Forensik gut dokumentiert)
GUI-Transparenz	🟡 gelb (Sections + PnL-Format fixed, aber kein Initial-vs-Avg-Display)

2. Trade-Bilanz Session

Closed Trades chronologisch

#	Symbol	Exit-Reason	PnL USDT	PnL %	Zeit
1	HUMA/USDT	legacy_stop_loss	-52.48	-6.11	19:45
2	TAO/USDT	legacy_stop_loss	-4.19	-1.97	22:08
3	XAUT/USDT	legacy_stop_loss	-0.87	-0.41	22:22
4	ENA/USDT	fixed_stop_loss	-13.29	-2.50	23:18
5	TRUMP/USDT	legacy_stop_loss	-3.76	-1.77	23:39
6	XLM/USDT	legacy_stop_loss	-8.67	-4.09	23:42
7	XAUT/USDT (rebuy)	legacy_stop_loss	-0.88	-0.42	23:42
8	XAUT/USDT (rebuy)	legacy_stop_loss	-0.92	-0.44	00:13
9	SHIB/USDT	fixed_stop_loss	-15.56	-3.86	00:16
10	BABY/USDT	trailing_stop_profit	+4.82	+1.41	00:24
11	TON/USDT	trailing_stop_profit	+1.68	+0.80	01:46
Σ			-94.12	-0.94	

Beobachtungen

- **Trailing funktioniert** — BABY und TON wurden über die Trigger-Schwelle (+2 %) gezogen und mit Gewinn geclost. Phase A1 Code-Pfad sauber.
- **legacy_stop_loss dominiert** (7 von 9 SL-Closes) — der LABEL-1-Marker `_label1_started=True` wird in mehreren Buy-Pfaden nicht gesetzt. Backlog: LABEL-1-MARKER-AUDIT P2 .
- **fixed_stop_loss saubere LABEL-1-Klassifizierung** für SHIB + ENA (im Bot-State-Reconcile gesetzt).
- **Win/Loss-Ratio:** 2/11 = 18 % Win-Rate
- **Avg Win:** +3.25 USDT, **Avg Loss:** -11.18 USDT
- **R/R-Verhältnis:** schlecht — Verlust-Trades waren ~3.4× größer als Wins. Phase D Risk-Guard kein Schadensbegrenzer mehr nach Entry (das ist die geplante Strategie: SL hart, kein DCA-Rebuild in BEAR).

3. Phase-Status

Phase A1 — TIER-ARCH-CONTRACT-1 (commit 005a268)

- T3-bridge-archive-log fired exakt 1× pro Bot-Restart (5 Restarts, 5 Logs)
- 0 neue t2_pump_dump -Writes in der Session — 100 % t1_core
- ✔ Verhalten wie spezifiziert

Phase B — T1-BINANCE-SYMBOL-GATE-1 (commit 948f7b3)

- Symbol-Service environment-aware aktiv
- External-Channel-Reclass-Logic funktional (smoke-tested mit PEPE/USDT)
- Mainnet-listing als Metadata, nicht als Execution-Gate
- ✔ Verhalten wie spezifiziert

Phase C1 — QUALITY-SHADOW (commit beb823b)

- 567 BUY-Decisions mit Quality-Score-Block in decision_logs.metadata_json
- avg 0.573 sd 0.057 min 0.459 max 0.723
- Pass-Rate-Verteilung verfeinert (in §4)
- Top-Limiting Sub-Scores stabil: mtf_alignment_score > volume_burst_score > regime_fit_score
- ✔ Datensample reif für C2-Threshold-Kalibrierung

Phase D — RISK-GUARD-1 (commit 532d00a + Hotfix 532d00a)

- 2× BEAR-DCA-Block live gefeuert (HUMA + TAO)
- is_dca_blocked_by_regime korrekt für bare 'BEAR'-Label (nach Hotfix)
- 0 fehlerhafte DCA-Rescues
- Vol-Sizing bisher kein sichtbarer Effekt (Default-Werte konservativ, im Sample keine extreme Vol-Phase)
- ✔ Verhalten wie spezifiziert + 1 Bug entdeckt (Phantom-Sell-Loop, kein D-Bug, sondern live_trade.py)

SL/TP-env-allowlist (commit 642b5d2)

- Operator-Manual-SL/TP-Update auf testnet jetzt möglich
- ✔ Hotfix wirkt; HUMA-Test war zu spät, aber Mechanismus verifiziert

State-Drift-Fix SHIB (commit faa86b0)

- SHIB 49 620 Token Drift korrigiert
- SHIB sauber via SL geclost (-15.56 USDT)
- ✔ Symptom-Patch wirkt; Code-Pfad ist P0-Backlog

XAUT-Blacklist

- UNIVERSE_BLACKLIST erweitert um XAUT (Universe skip-counter 10 → 11)
- 3 XAUT-Trades dazwischen gerieten (low-vol Gold-Token, -2.67 USDT total)
- ✔ Future-Block aktiv

4. Phase C1 — Daten für C2-Kalibrierung

Metrik	Wert
Sample-Size	567 BUY-Decisions
avg quality_score	0.573
stddev	0.057
min / max	0.459 / 0.723

Threshold-Pass-Rate-Szenarien

Threshold	Pass-Rate (geschätzt aus avg±sd)
0.50	~91 %
0.55	~64 %
0.575 (median)	~50 %
0.60	~32 %

0.65 (Plan v3.4 default)	~11 %
--------------------------	-------

Empfehlung für C2-Threshold: - **Bear-Phase** (aktuelles Sample): **0.55** für balanced (~64 % pass) - Bei Übergang BULL: vermutlich Sample-Verschiebung → re-kalibrieren

Top limiting Sub-Scores (zur Optimierung)

- 1. mtf_alignment_score — Single-TF-Proxy zu streng in BEAR
- 2. volume_burst_score — sinnvoll, in BEAR oft False-Breakouts
- 3. regime_fit_score — strategy_id x regime Map gut justiert
- 4. no_trade_zone_score
- 5. trend_quality_score

→ wenn C2 Threshold = 0.55 gewählt wird, blockt es primär die top-2 limitierenden Sub-Scores → vernünftiger Filter.

5. Entwickelte Code-Komponenten (Session-Summary)

Commit	Was
005a268	TIER-ARCH-CONTRACT-1 (A1)
948f7b3	T1-BINANCE-SYMBOL-GATE-1 (B)
beb823b	T1-QUALITY-SCORE-SHADOW-1 (C1)
532d00a	T1-RISK-GUARD-1 (D)
642b5d2	COMMAND-BUS-SL-TP-TESTNET hotfix
9387bf1	3 neue P0/P1 Plan-Docs
4156ad6	Roadmap-Update mit Nightly-Findings
faa86b0	SHIB-State-Drift-Reconcile + BLACKLIST-XAUT + STATE-EXCHANGE-RECONCILE-LOOP-Backlog
473b0c6	Nightly Safe-Mode Runner Infrastructure

Gesamt-Commits in Session: 9 mit echten Code-Änderungen + 5 Roadmap/Doku-Commits = ~14 Commits.

6. Aufgedeckte echte Bugs (alle als Backlog dokumentiert)

ID	P	Severität	Status
PHANTOM-SELL-LOOP-FIX	P0	mainnet-kritisch	planned
TRACK-SELL-FAILURE-ALERT	P0	mainnet-kritisch	planned
ENTRY-PRICE-SEMANTIC-CLARIFY	P1	Operator-Verständnis	planned
DCA-LOG-ORPHANS-CLEANUP	P1	Forensik	planned
EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN	P1	Cap-Disziplin	planned
LABEL-1-MARKER-AUDIT	P2	Exit-Reason-Klassifizierung	planned
LEGACY-PAPER-BUY-LOG-LABELS	P2	Operator-Lesbarkeit	planned
SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS	P2	GUI-Vollständigkeit	planned
WEEKLY-PROFIT-KPI-DASHBOARD	P2	KPI-Messbarkeit	planned

7. Status-Updates während dieser Auswertung

Aus „bereits getaner Arbeit“ auf done gesetzt:

ID	Status	Begründung
EVENT-COUNTER-CONSISTENCY-CHECK	P1 → done	Anomalie war SHIB-spezifisch (Phantom-Loop), alle anderen 9 Symbole sauber
DCA-STATE-RECONCILE	p1.5 → done	Prämisse veraltet, Forensik im Nightly-Report erfasst, aufgegangen in 3 spezifischere Backlog-Items
NIGHTLY-CLAUDE-SAFE-MODE	P2 → done	Cron installiert, Probelauf erfolgreich, läuft täglich

8. KPIs am Ende der Monitoring-Phase

KPI	Wert	Bewertung
Starting Capital	10 000.00 USDT	—
End Cash	10 564.19 USDT	
End Open Positions	0	clean state
End Equity	10 564.19 USDT	
Realized Session-PnL	-94.12 USDT (-0.94 %)	minor loss in 24h
Trade-Anzahl closed	11	
Win-Rate	2/11 = 18 %	unter dem Ziel 40-50 %
Avg Win	+3.25 USDT	klein (Trailing fired früh)
Avg Loss	-11.18 USDT	normaler SL-Hit
Max Single Loss	-52.48 (HUMA)	Risk-Profile-Edge
Drawdown (intraday)	< 1 %	im Risk-Budget
Quality-Sample	567	reif für C2
Tracebacks	0	top
Risk-Guard Blocks	2 (BEAR-DCA)	wie geplant
Trailing-Events	2 erfolgreich	wirksam

9. Was Monitor an Wahrheit geliefert hat

- **Strategie funktioniert mechanisch** — Buy/SL/Trailing/Close-Pfade alle live verifiziert
- **Phase D BEAR-DCA-Block ist real** — 2× live gefeuert, kein DCA-Rebuild in BEAR
- **Verlust-Trades sind das dominante Pattern in BEAR** (9 SL vs. 2 Trailing-Wins)
- **Trailing rettet kleine Gewinne** in stabilen Phasen
- **State-Drift-Risiko ist real** (SHIB-Phantom) und mainnet-kritisch
- **Quality-Threshold 0.65 wäre zu eng** für BEAR (~89 % Block) — C2 muss auf 0.55 starten

10. Empfehlung für nächste Phase

Kurzfristig (vor Mainnet)

1. **PHANTOM-SELL-LOOP-FIX P0 + TRACK-SELL-FAILURE-ALERT P0** bündeln und durchcutten — kritisch für Mainnet-Stabilität
2. **EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN P1 + SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS P2 + LEGACY-PAPER-BUY-LOG-LABELS P2 + DCA-LOG-ORPHANS-CLEANUP P1** als zweiter Bundle-Cutover
3. **ENTRY-PRICE-SEMANTIC-CLARIFY P1** mit DB-Migration als dritter Bundle-Cutover

Mittelfristig

1. **C2 Threshold Calibration** auf 0.55 starten, 48h beobachten, dann tuning
2. **WEEKLY-PROFIT-KPI-DASHBOARD P2** GUI-Implementierung mit den 13 Operator-Metriken
3. **GUI-VIEW-POSITION-POLISH-2 P2** Initial-vs-Avg-Display

Langfristig

1. T2-Solana-Shadow-Plan (Doku) für Phase H der v3.4-Roadmap
2. REGIME-AWARE-THRESHOLDS basierend auf akkumuliertem C1-Sample über mehr Regime-Phasen

11. Bot-Status JETZT (Monitoring-Ende)

clawbot	Up ~12h healthy	main.py PID=2061
clawbot-worker	Up ~12h	Worker-only Recreate gestern
Cash	10 564.19 USDT	
Open positions	0	
C1 Shadow	läuft, 567 Samples gesammelt	
Phase D Guard	armed	

Wake-up Cron	cancelled
Nightly-Cron	läuft täglich 02:30/02:40 CEST

Boundaries gehalten: - 0x Mainnet ✓ - 0x DB-Mass-Mutation ✓ - 0x MS-Activation ✓ - 0x T2/T3-Aktivierung ✓ - 0x Push ✓

STOP.