

# Entwickler-Bewertung — Steve-TradingBot Zwischen-Auswertung

**Quelle:** MONITOR\_REPORT\_20260517T221634Z.zip **Stamp:** 2026-05-17 22:16 UTC, Bewertung 2026-05-18 00:30 UTC **Bewerter:** technischer Code- + Daten-Audit **Boundaries:** Bot läuft uninterrupted; kein Eingriff während C1-Monitoring außer kritischem Risk.

## 1. Executive Summary

In 16 h Session-Laufzeit hat der Bot über 4 SOT-1d-Cutover (A1 / B / C1 / D + SL-TP-Hotfix) 0 Tracebacks produziert. Code-architektonisch ist Phase A1 (Tier-Contract) plus B (Binance-Pair-Gate) sauber gewired. Phase C1 sammelt mit 509 BUY-Samples brauchbare Quality-Shadow-Daten (avg 0.575, sd 0.055) — die im Plan v3.4 vorgeschlagene 0.65-Schwelle wäre mit nur 11 % Pass-Rate zu eng. Phase D BEAR-DCA-Block hat live 2× gefeuert und korrekt verhindert dass HUMA/TAO über DCA refinanziert wurden. Trading-Bilanz heute: **−56.67 USDT realized** (zwei Stop-Loss-Closes), 5 offene Positionen bei −1.90 % bis +0.01 %. Mehrere **Datenqualitäts-Defects** sind aufgedeckt: DCA-State auf File-Ebene reflektiert nicht alle Events, `entry_price` ist semantisch Average-nach-DCA, GUI zeigt das ohne Hinweis. Event-Counter inkonsistent (6 Stop-Loss-Trigger-Log-Hits aber nur 2 closed trades). Das 4 %-Wochenziel ist **derzeit nicht messbar** weil mehrere KPIs (Trefferquote, MAE/MFE, Capital-Time, DCA-Erfolgsquote) entweder nicht erhoben werden oder durch DCA-State-Inkonsistenz unzuverlässig sind.

### Ampelstatus

| Domäne          | Status | Begründung  |
|-----------------|--------|---|
| Stabilität      | grün   | 0 Tracebacks über 4 Cutover; healthy main.py; Worker-Recreate ohne Bot-Touch  |
| Risiko          | gelb   | Phase D arbeitet, aber EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN noch offen (Cap kann übergangen werden); kein Drawdown-Kill-Switch sichtbar |
| Performance     | gelb   | −0.53 % auf Equity (10 645 → 10 588 nach 2 SL-Closes); zu wenig Sample-Volume für „4 % / Woche“-Aussage                       |
| Datenqualität   | rot    | DCA-State-Persistence-Gap, <code>entry_price</code> -Semantik unklar, GUI ohne avg/tranches, Event-Counter inkonsistent       |
| GUI-Transparenz | orange | Polish-1 hat Sections + Back-Button, aber kein avg_price / DCA-Count / Tranches; nur ein Auszug der Wahrheit                  |

## 2. Bewertung der Zwischen-Auswertung

### 2.1 Offene Positionen (CSV 01, 5 Rows)

|                  |               |             |                         |               |
|------------------|---------------|-------------|-------------------------|---------------|
| ENA/USDT         | entry 0.10767 | cur 0.10630 | PnL -6.80 USDT (-1.28%) | SL-Buf 0.96 % |
| SHIB/USDT        | entry 5.92e-6 | cur 5.81e-6 | PnL -7.68 USDT (-1.90%) | SL-Buf 0.69 % |
| TRUMP/USDT       | entry 2.16300 | cur 2.15700 | PnL -0.59 USDT (-0.28%) | SL-Buf 1.22 % |
| XAUT/USDT        | entry 4545.91 | cur 4546.50 | PnL +0.03 USDT (+0.01%) | SL-Buf 0.21 % |
| XLM/USDT         | entry 0.15160 | cur 0.15110 | PnL -0.70 USDT (-0.33%) | SL-Buf 0.79 % |
| Unrealized total |               |             | -15.74 USDT             |               |
| Position-Wert    |               |             | 1 555.83 USDT           |               |

- **Plausibilität:** Pricing konsistent, PnL-Math stimmt im Display (nach `gui-positions-pnl-pct-display-fix`).
- **Critical:** SHIB SL-Buffer **0.69 %** und XAUT **0.21 %** — extrem knapp. Beide tradierbar bei nächstem Bear-Schub.
- **Anomalie ENA:** entry 0.10767 ist laut Code (`paper_trade.py:507`) der post-DCA-Average. Aus dem `bot_log` erwartet wäre 0.1077 nach 2 DCAs — passt zu Floating-Point-Rundung. **Aber** keine Aufzeichnung der ursprünglichen Initial-Entry-Quote → Operator weiß nicht, dass diese Position 2× nachgekauft wurde.
- **Anomalie XLM:** entry 0.15160 ist identisch zum allerersten Buy. Im `bot_log` gab es DCA bei 0.1510 mit neuem Avg 0.1524. **Im State steht das nicht** — XLM-DCA wurde **nicht persistiert** (oder zurückgerollt durch State-Reload).

### 2.2 Closed Trades (CSV 02, 2 Rows)

|                        |                              |                          |              |              |
|------------------------|------------------------------|--------------------------|--------------|--------------|
| HUMA/USDT              | exit_reason=legacy_stop_loss | pnl -52.48 USDT (-6.11%) | opened 10:52 | closed 19:45 |
| TAO/USDT               | exit_reason=legacy_stop_loss | pnl -4.19 USDT (-1.97%)  | opened 05:42 | closed 22:08 |
| Realized total session |                              | -56.67 USDT              |              |              |

- Beide Closes mit `legacy_stop_loss` — das ist der **LABEL-1-Fallback** für Positionen ohne `_label1_started=True`-Marker. HUMA/TAO waren beide neu eröffnet *nach* LABEL-1-Cutover → der Marker hätte gesetzt sein sollen. **Defect:** irgendwo wird der Marker nicht zuverlässig gesetzt (vermutlich External-Channel-Web-Buy oder Initial-Buy-Pfad).
- TAO-Loss −1.97 % ist atypisch klein für einen ATR-SL → vermutlich war SL bereits dicht am Entry (mgllw. nach Trailing). Da `trailing_events=0` in CSV 07, wahrscheinlich nicht.
- **duration\_seconds NULL** → SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS-Bug; das Feld wird im close-emit nicht berechnet.

### 2.3 Decision-Distribution (CSV 03)

|               |         |                |      |                                     |
|---------------|---------|----------------|------|-------------------------------------|
| evaluating    | t1_core | run_scan_cycle | BEAR | 4 499                               |
| reject        | t1_core | run_scan_cycle | BEAR | 3 955                               |
| buy           | t1_core | run_scan_cycle | BEAR | 544                                 |
| total         |         |                |      | 8 998                               |
| reject-Rate   |         |                |      | 87.9 % (gesund konservativ in BEAR) |
| buy/eval-Rate |         |                |      | 12.1 %                              |

- 100 % t1\_core — TIER-ARCH-CONTRACT-1 hält.
- 100 % BEAR-Regime — keine Regime-Variation in 16h. Sample limitiert auf BEAR-Bias.
- 544 buy-decisions vs. 7 tatsächliche Position-Opens (5 jetzt offen + HUMA closed + TAO closed = 7) → **emit\_decision feuert pre-cap und pre-sizer**. Discrepancy 537 ≈ 99 % der BUYs landen NICHT als Trade. Das ist im Wesentlichen die EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN - Problematik plus reguläre Cap-/Sizer-Rejects.

## 2.4 Quality-Shadow (CSV 04, 509 BUYs)

```
n=509 avg=0.575 stddev=0.055 min=0.459 max=0.723
Pass-Rate bei
0.50: 465/509 = 91.4 %
0.55: 327/509 = 64.2 %
0.60: 161/509 = 31.6 %
0.65: 55/509 = 10.8 %
```

**Befund:** Threshold 0.65 (Plan v3.4 default) wäre mit 10.8 % Pass-Rate zu eng — der Bot würde ~90 % seiner Setups blocken. Operator-relevanter Korridor: - **0.55** als balanced (64 %) - **0.60** als selektiv (32 %) - **0.65** als „Top-Decile-only“

Empfehlung für Phase C2: **0.575 ± 1σ** = Threshold-Band 0.52 ↔ 0.63 mit regime-spezifischer Abstufung. Konkreter Vorschlag (auf BEAR-Daten): C2 startet bei **0.55** für Test, kann tighter ziehen wenn Pass-Rate > 70 % bleibt.

## 2.5 Limiting Subscores (CSV 05)

|                     |     |      |
|---------------------|-----|------|
| mtf_alignment_score | 184 | 38 % |
| volume_burst_score  | 141 | 29 % |
| regime_fit_score    | 60  | 12 % |
| no_trade_zone_score | 42  | 9 %  |
| trend_quality_score | 27  | 6 %  |

- **mtf\_alignment\_score** ist Single-TF-Proxy (RSI + MACD bullish) → in einer BEAR-Phase praktisch immer schwach → korrekt limitierend, aber nicht echte „Multi-Timeframe“-Information. Sub-Score-Funktion ist **bewusst grob** lt. Code-Kommentar ( `quality_score.py: _score_mtf_alignment` ). **Verbesserung:** echtes 4h/1d-Confirmation einbauen würde Vorhersagekraft erhöhen.
- **volume\_burst\_score** zweitstärkster Limiter — sinnvoll, weil schwaches Volume in BEAR oft False-Breakouts produziert.

## 2.6 Phase Tracebacks (CSV 06)

5 Cutover, **0 Tracebacks** seit jeweiligem Cutover. Stabilität top.

## 2.7 Bot Events (CSV 07)

|                       |   |  |
|-----------------------|---|--|
| T3_bridge_archive_log | 5 | (= 5 Bot-Prozess-Restarts heute; korrekt, log-once)                    |
| risk_guard_blocks     | 2 | (HUMA + TAO BEAR-DCA-Blocks live verifiziert)                          |
| dca_rescue_attempted  | 0 | (= 0 Logs 'DCA-Rettung' = 0 tatsächliche Rescues; korrekt da geblockt) |
| dca_signal_emitted    | 2 | (Manager hat DCA proposed, RISK-GUARD hat geblockt)                    |
| stop_loss_triggered   | 6 | ▲ aber nur 2 closed_trades   |
| trailing_events       | 0 | (kein Trade hatte 2 % Gain → kein Trigger; konsistent)                 |

**Inkonsistenz:** 6 🟡 Stop-Loss getriggert vs. 2 closed trades. Mögliche Ursachen: - SL-Check trifft, aber DCA-Rescue blockt nicht das log-statement, sondern fällt drüber → log fires aber Close nicht (4 davon) - Mehrfacher Stop-Loss-Log-Print für gleichen Trade - Log-Grep matched auch Test-Strings

→ **EVENT-COUNTER-CONSISTENCY-CHECK P1:** forensisch klären.

# 3. Bewertung im Verhältnis zum Ziel „ca. 4 % Profit pro Woche“

## 3.1 Aktueller Stand vs. Ziel

|                       |  |
|-----------------------|--|
| Session-Start Equity  | ~10 700 USDT                               |
| Aktuell Equity        | ~10 588 USDT (Cash 9 032 + Pos-Wert 1 556) |
| Realized this session | -56.67 USDT                                |
| Unrealized            | -15.74 USDT                                |
| Session-PnL           | -72.41 USDT ≈ -0.68 %                      |

Bei 4 %/Woche entspricht das einem Ziel von **+428 USDT/Woche** auf 10 700 Basis. Aktuelle 16h-Bilanz: **-72.41 USDT** = -0.68 %. **Linear projiziert** wäre das -7.1 %/Woche — aber Linearprojektion ist hier statistisch unzulässig.

## 3.2 Ist das Ziel mit aktueller Strategie realistisch messbar?

**Nein**, derzeit nicht. Probleme: 1. **Sample-Volumen zu klein:** 2 closed trades in 16h → keine Statistik möglich 2. **Ein Regime:** 100 % BEAR im

Sample → keine Bull-/Range-Phase zur Vergleichbarkeit 3. **DCA-State unzuverlässig**: avg-Entry-Anzeige inkorrekt → PnL-Berechnung kann auf Tranchen-Ebene falsch sein 4. **Cap-Bug**: EXTERNAL-CHANNEL erlaubt 6/5 Positionen → Risk-Profile nicht reproduzierbar

### 3.3 Welche KPIs fehlen?

Aus Operator-KPI-Liste:

| KPI                         | aktuell verfügbar                       | wie messen?  |
|-----------------------------|---|--|
| Wochen-PnL                  | ✓ via trade_logs realized + unrealized  | aggregieren, jetzt machbar                                   |
| Max Drawdown                | ✗ nicht persistiert                     | neuen Equity-Snapshot pro Cycle in DB                        |
| Trefferquote                | ✗ (nur 2 Trades, beide Loser)           | ≥30 Trades nötig für Aussage                                 |
| Avg Win / Avg Loss          | ✗                                       | derselbe Daten-Mangel  |
| Risk/Reward                 | ✓ pro Trade via SL/TP berechenbar       | aus trade_logs derivierbar                                   |
| Exposure-Zeit               | teilweise                               | duration_seconds NULL → SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS-Fix nötig |
| Stop-Loss-Häufigkeit        | ✓ via exit_reason                       | gegeben, aber sample n=2                                     |
| DCA-Erfolgsquote            | ✗ State-Inkonsistenz                    | erst nach DCA-STATE-RECONCILE                                |
| Risk-Guard-Blockrate        | ✓ via log-grep                          | aktuell 2 / 2 Block-Events = 100 % BEAR-Block                |
| Buy-Decisions vs. Orders    | ✓ via decision_logs vs. trade_logs      | 544 buys / 7 orders = 1.3 %                                  |
| Kapitalbindung pro Position | ✓ via position_snapshots.position_value | gegeben  |
| Netto-Performance nach Fees | ✓ trade_logs.fees + realized_pnl        | gegeben  |
| Stabilität über Marktphasen | ✗ einseitig BEAR                        | Daten aus 2+ Wochen mit Phasenwechsel nötig                  |

### 3.4 Datenbasis vor Aktivierungs-Optimierung

**Minimum für 4 %-Ziel-Bewertung**: 30 closed trades über min. 2 unterschiedliche Regimes (BEAR + RANGE/BULL). Bei aktuellem Rate 7 trades / 16h → ~7 Tage. Mit BEAR-Bias und Risk-Guard-Blocks tendiert das eher zu 10-14 Tagen.

## 4. Technische Befunde

### 4.1 DCA-State-Inkonsistenzen

**Code-Fakt** ( paper\_trade.py:507 ):

```
pos['entry_price'] = round_price(new_cost / new_qty, price) # Neuer Durchschnittspreis
```

→ live\_portfolio.json.entry\_price ist **nach DCA der gewichtete Durchschnitt**, nicht der Initial-Entry.

**Consequence**: Operator sieht in /admin/positions einen entry\_price, der semantisch wackelt: - bei Position ohne DCA: == Initial-Entry - bei Position mit DCA: == aktueller Average - bei Position mit DCA aber State-Verlust (XLM): == Initial-Entry (DCA-Wirkung verschwunden)

Es gibt keine GUI-/State-Anzeige für **Initial-Entry** + **Tranchen-Liste** als Zusatz.

### 4.2 State-Persistence-Risiken

**Beobachtet**: XLM hatte bestätigte DCA-Rettung 2026-05-16 07:14, aber dca\_log.json zeigt dca\_count=0 und live\_portfolio.json entry\_price=0.1516 (Initial), nicht 0.1524 (post-DCA-Avg).

Mögliche Ursachen: 1. \_save\_state() Race nach DCA und vor Crash/Restart 2. mtime-cookie-Reload (HISTORY-1 Fix B) hat externe Mutation als „neuer“ Zustand interpretiert 3. KITE-Repair-File-Edit vom 2026-05-16 hatte unbeabsichtigte Cross-Position-Effekte

Forensik vor Code-Fix nötig → **DCA-STATE-RECONCILE P1.5** (Plan existiert).

### 4.3 trade\_logs-Limitierungen

trade\_logs enthält nur closed\_trades (status='closed'). Für offene Positionen → keine Quelle. Die DCA-Tranchen sind nicht abrufbar. Für GUI / Analytics ist trade\_logs nicht alleine ausreichend.

### 4.4 position\_snapshots-Nutzung

Time-Series-Log mit per-scan-tick (~2 min). Pro offener Position wachsen die Rows linear (23 218 rows aktuell). Per-scan-emit (main.py:448) trägt nur **volatile** Felder (current\_price, unrealized\_pnl, position\_value) — die statischen Identifier (decision\_id, opened\_at, strategy\_id, profile\_id, risk\_reward, metadata) bleiben leer auf den Snapshot-Rows. → SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS-Backlog.

### 4.5 Adminpanel-/GUI-Schwächen

- PositionSnapshotResource zeigt **post-DCA-Average** als „entry\_price“ ohne Hinweis
- Kein avg\_price Feld
- Kein dca\_count / tranches -Liste
- Kein Initial-Entry-Differential-Anzeige
- unrealized\_pnl\_pct jetzt korrekt nach gui-positions-pnl-pct-display-fix (×100)
- View-Position-Detail hat 5 Sections + Back-Button nach gui-view-position-polish-1
- **Aber**: viele Felder NULL weil per-scan-emit dünn (SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS)

## 4.6 Event-Counter-Inkonsistenzen

```
stop_loss_triggered 6      vs.  closed_trades  2
dca_signal_emitted  2      vs.  risk_guard_blocks  2  (passt)
```

6 → 2 ist plausibel wenn: - DCA-Rescue versucht, blocked, log printed, dann fall-through zu SL-Trigger → 2× Log pro Close (DCA-Signal + SL-Triggered) - Multiple Update-Cycles vor finaler Close-Execution

→ **EVENT-COUNTER-CONSISTENCY-CHECK P1**: forensisch klären, Counter sauber benennen.

## 5. Risikoanalyse

| Risiko   | Severity | Wahrscheinlichkeit    | Mitigation   |
|--|----------|-----------------------|--|
| <b>Trading</b> : SL nicht eingehalten, weil entry_price nach DCA falsch interpretiert  | hoch     | mittel                | Code-Fakt: SL ist im State korrekt, nur Display zeigt avg als entry. Trading-Logik nicht betroffen, <b>PR-Anzeige + Operator-Decision-Basis aber schon</b> |
| <b>Datenqualität</b> : GUI zeigt avg, Operator denkt Initial-Entry   | hoch     | hoch                  | Quick: GUI-Hinweis-Label „avg after DCA“; Full: separates Feld initial_entry + tranches  |
| <b>Operator-Risk</b> : Operator setzt SL/TP auf Basis falschen entry_price-Verständnisses  | mittel   | mittel                | Tooltip / Section-Header in View-Position; Backlog GUI-VIEW-POSITION-POLISH-2  |
| <b>State-Persistence</b> : XLM-ähnliche DCA-Drops in Zukunft   | mittel   | mittel                | DCA-STATE-SAVE-RACE-FIX nach Forensik  |
| <b>PnL-Berechnung falsch</b> : avg-Entry-Inkonsistenz beeinflusst unrealized_pnl-Display   | niedrig  | hoch                  | unrealized_pnl wird live aus current+entry+qty berechnet — wenn entry korrupt (XLM), ist PnL falsch. Operator-relevant für Risk-Decision                   |
| <b>EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN</b> : 6/5 Positionen möglich   | mittel   | nicht-deterministisch | Fix steht im Backlog P1  |
| <b>Quality-Threshold-Drift</b> : Ohne sample > 100 BUYS per Regime keine seriöse C2-Schwelle                                     | mittel   | hoch                  | C2 erst nach 24-48h sample MIT Phasen-Variation  |
| <b>DCA-Erfolgsquote unbekannt</b> : aktuell 0 erfolgreiche Rescues (alle blockt BEAR), keine Datenbasis für DCA-Sinn-Validierung | niedrig  | hoch                  | BEAR-Block ist Operator-Decision; sample aus BULL nötig  |
| <b>CronCreate session-only Wake-up</b> geht verloren bei Session-End   | mittel   | mittel                | Host-cron als Backup setzen  |

## 6. Verbesserungsvorschläge (priorisiert)

| ID                              | Titel   | P    | Nutzen                            | Risiko             | Aufwand | Files/Module                    | Abhängig             | Empfehlung          |
|---------------------------------|---|------|-----------------------------------|--------------------|---------|---------------------------------|----------------------|---------------------|
| DCA-STATE-RECONCILE             | DCA-State forensisch rekonstruieren           | P1.5 | hoch (Trust-Wiederherstellung)    | 0 (read-only)      | 1-2 h   | logs, dca_log.json, snapshots   | Monitor-Ende         | <b>nach Monitor</b> |
| DCA-STATE-SAVE-RACE-FIX         | atomare Persistenz nach DCA-Rettung           | P1   | hoch (Daten-Integrität)           | mittel (Bot-Touch) | 4-6 h   | paper_trade._save_state, mtime  | DCA-RECONCILE        | später (cutover)    |
| EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN      | regime_cap auch in web/telegram-Pfaden        | P1   | hoch (Cap-Disziplin)              | klein              | 1 h     | main.py:970+1109                | —                    | nach Monitor        |
| SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS      | per-scan-emit füllt opened_at/decision_id/etc | P2   | mittel (GUI-Vollständigkeit)      | klein              | 2 h     | main.py:448                     | bundle mit Cap-Align | nach Monitor        |
| EVENT-COUNTER-CONSISTENCY-CHECK | 6 SL-trigger vs 2 closes klären               | P1   | hoch (Trust in Metrics)           | 0                  | 2 h     | bot_stdout-Parser + Doku        | —                    | nach Monitor        |
| GUI-VIEW-POSITION-POLISH-2      | initial_entry + avg + dca_count + tranches    | P2   | hoch (Operator-Transparenz)       | klein              | 4 h     | PositionSnapshotResource        | SNAPSHOT-EMIT-COMP   | nach SNAPSHOT-EMIT  |
| WEEKLY-PROFIT-KPI-DASHBOARD     | KPI-Widget: WeeklyPnL/Drawdown/Hitrate/etc    | P2   | hoch (Ziel-Messbarkeit 4%)        | klein              | 6 h     | neue Filament-Page + KPIBuilder | trade_logs sample    | später              |
| LABEL-1-MARKER-AUDIT            | warum HUMA/TAO als legacy_stop_loss?          | P2   | mittel (Exit-Subtype-Korrektheit) | klein              | 1 h     | execute_buy paths               | —                    | bundle mit P2-GUI   |
| C2-THRESHOLD-CALIBRATION        | Threshold 0.55 für C2 ableiten + AB-Test-Plan | P2   | hoch (Quality-Logic enforce)      | mittel (Bot-Touch) | 4 h     | quality_score.py + main.py      | DECISION-GATE        | nach 24h sample     |
| HOST-CRON-WAKE-UP-BACKUP        | Host-side cron als Backup für CronCreate      | P3   | klein (Resilienz)                 | 0                  | 10 min  | /etc/cron.d                     | —                    | nice-to-have        |
| RISK-GUARD-TELEGRAM-RATE-LIMIT  | Operator-Notify nur 1× / 60 min               | P3   | klein (Spam-Schutz)               | klein              | 3 h     | reporter.py + aggregator        | —                    | nice-to-have        |

## 7. Konkrete empfohlene nächste Schritte

### Was als Nächstes umgesetzt werden soll

1. **Monitor weiterlaufen lassen** bis Wake-up 14:00 UTC am 2026-05-18 (bereits eingestellt).
2. **Nach Wake-up:** DCA-STATE-RECONCILE als 1.5h read-only Forensik → liefert Klarheit über XLM-DCA und entry\_price-Semantik.
3. **Direkt danach** Bundle-Cutover (Bot-Touch, 1 Recreate):
4. EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN (Cap-Disziplin)
5. SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS (GUI-Felder)
6. Optional: LABEL-1-MARKER-AUDIT wenn quick win
7. **Dann** GUI-VIEW-POSITION-POLISH-2 mit initial\_entry + tranches + dca\_count.
8. **Erst dann** C2 Threshold Calibration auf Basis der frischen + reichhaltigen Daten.

### Was aktuell nicht angefasst werden darf

- Bot main.py (PID=300 healthy) → 0 Recreate während Monitor
- Worker neu in Ruhe (post SL-TP-Hotfix) → kein zweiter Cutover bevor nötig
- C1-Quality-Threshold-Tuning → keine Code-Änderung, nur Daten sammeln
- State-Files (live\_portfolio.json, dca\_log.json) → 0 Edit ohne separates Operator-GO

### Was zuerst forensisch geklärt werden muss

1. **DCA-STATE-RECONCILE:** warum XLM-DCA verloren? → Plan existiert
2. **EVENT-COUNTER-INCONSISTENCY:** 6 vs 2 → trivial via log-walking
3. **LABEL-1-MARKER:** warum legacy\_stop\_loss bei post-LABEL-1-Trades? → execute\_buy-Pfad-Audit

## 8. Backlog-Vorschlag

Bereits in `gui/docs/roadmap/ROADMAP.php` gepinnt:

- `COMMAND-BUS-SL-TP-TESTNET` P1 ✓ done
- `DCA-STATE-RECONCILE` P1.5 — plan `docs/PLAN_DCA_STATE_RECONCILE.md`
- `DCA-STATE-SAVE-RACE-FIX` P1 — folgt nach Forensik
- `EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN` P1 — plan `docs/PLAN_EXTERNAL_CHANNEL_CAP_ALIGN.md`
- `SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS` P2 — plan `docs/PLAN_SNAPSHOT_EMIT_COMPLETENESS.md`

- GUI-VIEW-POSITION-POLISH-1 P2 ✓ done (Sections + Back-Button)
- GUI-POSITIONS-LIST-FIX P2 ✓ done
- RISK-GUARD-TELEGRAM-RATE-LIMIT P3 — plan docs/PLAN\_RISK\_GUARD\_TELEGRAM\_RATE\_LIMIT\_P3.md

#### Neu vorgeschlagen aus dieser Bewertung:

- EVENT-COUNTER-CONSISTENCY-CHECK **P1** (read-only, forensic + naming-cleanup)
- LABEL-1-MARKER-AUDIT **P2** (warum legacy\_stop\_loss bei post-LABEL-1-Trades)
- GUI-VIEW-POSITION-POLISH-2 **P2** (initial\_entry + tranches + dca\_count)
- WEEKLY-PROFIT-KPI-DASHBOARD **P2** (Filament-KPI-Page mit den 13 Operator-Metriken)
- C2-THRESHOLD-CALIBRATION **P2** (Threshold 0.55 + AB-Test)
- HOST-CRON-WAKE-UP-BACKUP **P3** (Resilienz für [session-only] -Wake-ups)

---

## 9. Fazit

### Ist der Bot auf Kurs?

**Code-stabilitätsseitig: ja** — 0 Tracebacks, 5 Cutover ohne Drama, Phase A1/B/C1/D wired, Risk-Guard live bei 2 Real-Events korrekt gefeuert.

**Datenqualitätsseitig: nein** — DCA-State unzuverlässig, GUI zeigt avg ohne Hinweis, Event-Counter inkonsistent, LABEL-1-Marker nicht überall gesetzt. Vor einer Performance-Bewertung muss das geheilt werden.

**Performance-seitig: zu wenig Daten** — 7 Trades in 16h, 1 Regime, knapp 60 USDT realized loss. Für ein 4 %-Wochen-Statement braucht es 2-3 Wochen, mehrere Marktphasen, und konsistente State-Files.

### Ist das 4 %-Wochenziel aktuell seriös bewertbar?

**Nein.** Daten-Basis fehlt. KPIs teils nicht erhoben. State-Inkonsistenz verzerrt Stichproben.

### Was muss vor aggressiver Optimierung zwingend erledigt werden?

1. DCA-STATE-RECONCILE + Folge-Code-Fix (Daten-Integrität)
2. EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN (Risk-Disziplin)
3. SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS (GUI/Analytics)
4. WEEKLY-PROFIT-KPI-DASHBOARD (Messbarkeit)
5. Sample-Sammeln über min. 30 Trades und 2 Regimes

Erst dann Phase C2 / regime-aware-thresholds / T1-profile-configs. Vorher würde der Bot Risiken multiplizieren auf einer unsicheren Datenbasis.

---

**Stilanmerkung:** Diese Bewertung ist optimiert auf Operator-Entscheidung — keine Floskeln, jede Aussage codegestützt. Quellen: 7 CSVs des Reports + Code-Lektüre in `paper_trade.py`, `main.py`, `quality_score.py`, `risk_guard.py`.

**STOP.**