

# PLAN\_EXTERNAL\_CHANNEL\_CAP\_ALIGN

**Status:** planned (backlog, awaits operator GO) **Priority:** P1 **Erstellt:** 2026-05-17 **Quelle:** Audit während C1-Monitoring 2026-05-17 — Bot hielt 6 statt 5 Positionen in BEAR-Regime **Roadmap-ID:** EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN **Voraussetzung:** C1-Monitoring durch; idealerweise mit SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS gebündelt im selben Cutover (beides Bot-Touch).

## 1. Bug-Beschreibung

Operator-Beobachtung: Bot hält 6 offene Positionen, obwohl der Regime-Detektor `max_positions=5` für BEAR liefert.

Beleg aus `bot_stdout.log` 2026-05-17 10:51-10:52 UTC (HUMA-Open):

```
10:51:53 Scanner Kandidat HUMA Score 6.0
        → risk_mgr.check_open_positions(5, max_pos=5)=True → BLOCK ✓
10:51:53 Log: "Max offene Positionen erreicht: 5/5 (source=regime cap=5 global=10)"
10:51:54 Telegram-Scraper liefert HUMA-Signal
10:51:57 Web-Channel: HUMA Score 10.0 → ✓ TRADE!
        → risk_mgr_shared.check_open_positions(5, max_override=None)
        → fallback auf global_max=10
        → 5 < 10 → ALLOW ✗
10:52:05 PAPER BUY HUMA → 6. Position open
10:54:27 Log: "Max offene Positionen erreicht: 6/5" (jetzt erst eskaliert)
```

## 2. Root cause

`trading/execution/risk_manager.py:105` `check_open_positions(open, max_override=None, active_config=None)`:

```
if max_override is not None:
    effective_max = min(max_override, global_max)
else:
    effective_max = global_max    # ← Bypass-Pfad
```

Beim Wegfall des `max_override` (regime cap) greift `global_max=10` aus Settings (`MAX_OPEN_POSITIONS=10`). Der regime-spezifische BEAR-Cap=5 wird damit unbeachtet ignoriert.

In `trading/main.py` gibt es **drei** BUY-Pfade mit unterschiedlichen Aufrufkonventionen:

Zeile	Pfad	Aufruf	Effektiver Cap
~898	Scanner approved-BUY	<code>check_open_positions(open, max_pos, active_config)</code> mit <code>max_pos=regime.max_positions</code>	<b>regime=5</b> ✓
~970	Web-Scraper Channel	<code>check_open_positions(open, active_config=active_config)</code> ohne <code>max_override</code>	<b>global=10</b> ✗
~1109	Telegram-Bot Channel	<code>check_open_positions(open, active_config=active_config)</code> ohne <code>max_override</code>	<b>global=10</b> ✗

Die External-Channel-Pfade umgehen daher unbeabsichtigt den regime-Cap.

## 3. Fix (Scope)

Minimal-Diff: an beiden External-Channel-Aufrufen den `max_pos` zur regime-Auflösung mitschleifen, exakt wie im Scanner-Pfad:

```
# main.py:898 (Scanner) – unverändert, dient als Referenz
max_pos = regime.get('max_positions', 5) if regime else 5
if not risk_mgr.check_open_positions(portfolio['open_positions'], max_pos, active_config=active_config):
    ...

# main.py:~970 (Web-Channel) – ergänze max_pos
max_pos_w = regime.get('max_positions', 5) if regime else 5
if not risk_mgr_shared.check_max_drawdown(portfolio) and \
    not risk_mgr_shared.check_open_positions(portfolio['open_positions'], max_pos_w, active_config=active_config):
    ...

# main.py:~1109 (Telegram-Bot Channel) – ergänze max_pos
max_pos_b = regime.get('max_positions', 5) if regime else 5
if not risk_mgr_shared.check_max_drawdown(portfolio) and \
    not risk_mgr_shared.check_open_positions(portfolio['open_positions'], max_pos_b, active_config=active_config):
    ...
```

Diff < 10 Zeilen Code.

## 4. Boundaries

- **Bot-Touch:** ja ( main.py x2 Stellen). Container-Recreate notwendig.
- 0x Strategieparameter-Tuning
- 0x DB-Migration
- 0x DB-Mass-Mutation (bestehende 6. Position bleibt offen; SL/TP funktionieren weiter, kein Force-Close)
- 0x Mainnet
- 0x Worker-Recreate
- 0x CommandBus-Version-Bump
- 0x Push ohne separates GO

## 5. Auswirkung auf bestehende Überzahl-Positionen

Die aktuelle Überzahl (6 statt 5) bleibt nach dem Fix bestehen — wird **NICHT** force-closed. Verhalten nach Cutover: \* Keine neuen External-Channel-BUYs solange `open_positions >= regime_cap`. \* Bestehende 6 Positionen laufen normal mit SL/TP/Trailing weiter. \* Sobald eine Position via SL/TP/manual close geschlossen ist und `open_positions < 5` fällt, sind neue BUYs wieder möglich. \* Operator könnte optional via `/admin/positions` Detail-Action `closeAtMarket` eine Position manuell schließen, um sofort auf 5 zu kommen. **Nicht erforderlich für den Fix.**

## 6. Cutover-Plan (SOT-1d)

1. Pre-cutover snapshot (HEAD, container PID, env flags, position-count).
2. Watchdog freeze `CUTOVER_FREEZE_EXTERNAL_CHANNEL_CAP_ALIGN`.
3. `docker compose build clawbot`.
4. Container-Test im neuen Image: `python3 -m unittest tests.test_external_channel_cap_align`
5. `docker compose up -d --force-recreate --no-deps clawbot`.
6. 3-Way MD5 Repo == Image == Container für main.py.
7. Bot spawn + healthcheck + 0 Tracebacks.
8. Live-Verify: Log enthält Max offene Positionen erreicht: X/5 (source=regime cap=5 global=10) auch für External-Channel-Pfade, nicht mehr nur Scanner.
9. Watchdog re-enable.
10. Roadmap-Update EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN → done.

## 7. Tests (Plan)

trading/tests/test\_external\_channel\_cap\_align.py (neu):

- AST-Guard: alle drei `check_open_positions` -Aufrufe in `main.py` haben ein `max_pos` -Argument (zweites positional oder named).
- AST-Guard: keiner der drei Pfade ruft `check_open_positions` mit nur `active_config=...` (zwei Argumente ohne `max_override`).
- Optional unit-test gegen RiskManager: regime-cap wird respektiert wenn übergeben.

## 8. Bundle-Empfehlung

Da beide Items ( `SNAPSHOT-EMIT-COMPLETENESS` P2 + `EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN` P1) Bot-Touch + Container-Recreate brauchen, empfiehlt sich ein **gemeinsamer Cutover**:

- gemeinsamer Build → ein Image rebuild
- gemeinsamer Recreate → eine Bot-Downtime von ~30s statt zweimal
- zwei separate Commits (klare Forensik), gleicher Cutover-Block

Priorität-Reihenfolge bleibt: P1 vor P2. Operator entscheidet beim GO.

## 9. Erwartete Lieferung

---

- `trading/main.py` Diff < 10 Zeilen.
- 1 neue Test-Datei mit ~3-5 Tests.
- Tests grün (104/104 nach Cutover inkl. bestehender Phase-D-Tests).

Commit-Vorschlag: `external-channel-cap-align: respect regime max_positions in web/telegram channels`

## 10. STOP

---

Kein Code vor Operator- GO `EXTERNAL-CHANNEL-CAP-ALIGN`.

Bis dahin: \* Cap-Bug bleibt aktiv — External-Channels können bis `global_max=10` Positionen öffnen. \* In aktueller Marktphase (BEAR + Threshold-Block + Quality-Shadow) ist External-Channel-Aktivität dünn → praktischer Schaden begrenzt. \* C1-Monitoring läuft ununterbrochen weiter, sammelt Quality-Shadow-Daten.