

T1 / T2 Strategy-Profile-Plan — Konfigurationsentwurf

Stand: 2026-05-16 · Branch `master` · HEAD `7e5cf6e` **Status:** `Plan`, keine Implementation. Read-only Vorschlag basierend auf FULLSTACK-ARCH-ERROR-REVIEW + heutiger Live-Beobachtung.

1. Executive Summary

T1 und T2 sollen **echte unabhängige Strategie-Profile** werden statt nur DB-Klassifizierungs-Labels (Backlog-Pin STRATEGY-GROUP-CONFIG-1 + Architektur-Review von heute).

Profil-Philosophie:

T1 Standard	→ Conservative Core Trading Mid-/Large-Caps, längere Holds, mean reversion + trend follow Geringe Drawdown-Akzeptanz, Stabilität vor Maximum Profit
T2 Momentum	→ Aggressive Pump-/Listing-/Breakout-Hunting Volatilere Symbols, kürzere Holds, tighteres SL aber höhere TP-Multiples, Time-Stop greift früh

Die Profile **konkurrieren nicht** — sie laufen parallel auf getrennten Cash-Buckets, mit klaren Symbol- und Strategie-Filtern. Das Ziel ist **unkorrelierter PnL**: wenn T1 in einem BEAR-Range schläft, soll T2 durch frühere Breakouts/Listings noch produktiv sein.

2. Was T1 und T2 heute tatsächlich machen (Ist-Stand)

T1 heute

Aspekt	Wert
Trigger	Legacy <code>main.run_scan_cycle</code> Score-Pipeline
Score-Formel	<code>0.7 × tech_score + 0.2 × news_sentiment + 0.1 × fear_greed</code>
Threshold	Dynamisch (heute BEAR: 7.5, im Testnet-Cap auf 6.0 begrenzt)
Symbol-Filter	Binance USDT-Universe, min 1M USD 24h-Volume, max 0.30 % spread
Position-Sizing	RiskManager via ATR-Stop-Distance, Cash-Tier-basiert
SL/TP	2× ATR Stop, 4× ATR TP (Default, regime-modifiziert)
Trailing	Standard (PositionManager: News/Breakeven/96h-Hard-Exit)
Max-Positions	Regime-abhängig (BEAR 5, BULL 8, default 10)
DCA	Aktiv (3% Gap unter SL → Nachkauf statt Verkauf)
Hold-Dauer	offen — bis SL/TP/Trailing/Time-Stop
DB-Label	<code>t1_core</code>

T2 heute

Aspekt	Wert
Trigger	3 separate Pfade in main.py: (a) web-channel signals, (b) telegram-bot-channel signals, (c) T3-forwarded large-cap signals
Score	nicht eigenständig — übernimmt das aus dem Signal-Quell-Datensatz
Position-Sizing	gleicher PositionSizer wie T1, eine <code>tranche_1</code> (~40 % des Score-Tier-Vorgabewerts)
SL/TP	aus dem Signal übernommen (web/telegram-channel-eigen oder Default)
Hold-Dauer	offen, gleiche Exit-Regeln wie T1
DB-Label	<code>t2_pump_dump</code>

→ T2 ist heute **kein eigenständiges Profil**, sondern nur eine DB-Markierung für "Signal kommt nicht aus dem Score-Scanner". Die Risk-/Exit-Logik ist identisch zu T1.

→ MS-Runner-Trades wären heute auch `t1_core` (siehe Architektur-Review).

3. Design-Prinzipien für die neuen Profile

- Eindeutige Trennung pro Symbol-Cluster:** T1 darf nicht denselben Trade wie T2 öffnen (kein Doppel-Kauf).
- Eindeutige Trennung pro Strategie-ID:** `breakout` und `volatility_sweep` → T2. `trend_follow`, `mean_reversion`, `vwap_mean_reversion` → T1. (Operator-Entscheidung im Review-PDF)

- 3. **Eigene Cash-Quote:** T1 nimmt nicht alles Cash. T2 muss eine eigene Sub-Bucket-Cash-Tasche haben, sonst wird das aggressive Profil vom konservativen ausgehungert.
- 4. **Eigene Risk-Profile:** T1 = breitere SL (mehr Rauschen tolerieren), niedrigerer TP-Multiple T2 = tighter SL (Pumps reversieren brutal), höherer TP-Multiple, zwingender Time-Stop
- 5. **Unterschiedliche Symbol-Filter:** T1 = Large-Cap-Universe (Top-50 USDT-Pairs, min 5M USD 24h-Vol) T2 = Mid-Cap + neue Listings, min 500K USD 24h-Vol, neu gelistete Pairs explizit erlaubt
- 6. **Trotzdem gemeinsame Mainnet-Boundary:** BINANCE_TESTNET=true bleibt für beide. Keine Mainnet-Aktivierung in dieser Phase.

4. T1 Standard — Konfigurationsvorschlag

4.1 Trigger-Quellen

Quelle	Aktiv für T1?	Notiz
Legacy <code>run_scan_cycle</code> Score-Pipeline	ja	unverändert
MS-Runner <code>trend_follow</code> Strategy	ja	nach STRATEGY-GROUP-CONTRACT-1
MS-Runner <code>mean_reversion</code> Strategy	ja	counter-trend, RSI-extremes
MS-Runner <code>vwap_mean_reversion</code> Strategy	ja	VWAP-Range-Trading
Web-Channel-Signals	nein	bleiben T2
Telegram-Bot-Channel-Signals	nein	bleiben T2
T3-forwarded Signals	nein	bleiben T2
MS-Runner <code>breakout</code>	nein	T2
MS-Runner <code>volatility_sweep</code>	nein	T2

4.2 Symbol-Filter T1

```
universe           = Binance USDT-Spot
min_24h_volume     = 5_000_000  USDT      (heute 1M, T1 zieht auf Mid-Cap+)
max_spread_bps     = 30           (0.30 %, wie heute)
exclude_leveraged  = true
exclude_stables    = true (N7.2 safety_check)
whitelist_caps     = Top-50 nach 30d-Volumen
exclude_t2_symbols_when_t2_holds_them = true  (Doppel-Buy-Verbot)
```

4.3 Position-Sizing T1

```
cash_quote         = 70 %           # T1 bekommt 70 % des frei verfügbaren Cash
max_positions      = 6              # regime-modifiziert (BEAR -1, BULL +2)
tier_high_pct      = 6 %            # Score >= 9.0 → 6 % der T1-Cash-Quote
tier_mid_pct       = 4 %            # Score >= 8.0 → 4 %
tier_low_pct       = 2 %            # Score >= 7.0 → 2 %
min_position_usd   = 50
max_position_usd   = 600
```

4.4 Risk-Profile T1

```
sl_atr_mult        = 2.0            # konservativ
tp_atr_mult        = 4.0            # 1:2 R:R
use_fixed_tp       = true
trailing           = aktiv (Default Trailing-Step)
breakeven_after_h  = 60             # nach 60h auf BE ziehen
time_stop_h        = 96             # Hard-Exit nach 96h
dca_enabled        = true
dca_max_gap_pct    = 3              # Nachkauf bis 3 % unter SL
dca_max_count      = 2
```

4.5 Score-Threshold T1

```
threshold_BULL     = 7.0
threshold_BEAR     = 7.5
threshold_RANGE    = 7.5
threshold_HIGH_VOL = 8.0            # höher gegen Whipsaws
testnet_cap        = 6.0            # heute: erlaubt mehr Trades zum Beobachten
```

4.6 GUI-Ansicht T1

- KPI-Card "T1 Standard" zeigt: open_positions, exposure_usdt, realized_pnl_7d, unrealized_pnl, hit_rate_7d
- TradeLog-Filter "T1 Standard" zeigt nur konservative Closes

5. T2 Momentum/Pump — Konfigurationsvorschlag

5.1 Trigger-Quellen

Quelle	Aktiv für T2?	Notiz
MS-Runner <code>breakout</code> Strategy	ja	Volatility-Breakout
MS-Runner <code>volatility_sweep</code> Strategy	ja	High-Vol Hunt
Web-Channel-Signals	ja	pump-typische external feeds
Telegram-Bot-Channel-Signals	ja	dito
T3-forwarded large-cap-Pump Signals	ja	Tier3-Bridge
Legacy Score-Pipeline	nein	bleibt T1
MS-Runner trend_follow / mean_rev / vwap	nein	T1

5.2 Symbol-Filter T2

```

universe          = Binance USDT-Spot + neue Listings (last 30 days)
min_24h_volume    = 500_000    USDT      (mehr Risiko, mehr Symbols zugänglich)
max_spread_bps    = 80          (0.8 % – bei Pumps oft hoch)
exclude_leveraged = true
exclude_stables   = true
new_listing_priority = true      # neue Pairs +1 Score-Boost
exclude_t1_symbols_when_t1_holds_them = true

```

5.3 Position-Sizing T2

```

cash_quote        = 25 %      # T2 bekommt 25 % des frei verfügbaren Cash
max_positions     = 10        # mehr Streuung, kleinere Tickets
tier_high_pct     = 4 %       # kleinere Max-Tickets gegen Volatilität
tier_mid_pct      = 2.5 %
tier_low_pct      = 1.5 %
min_position_usd  = 30
max_position_usd  = 250

```

(Restliche 5 % = Buffer / Reserve, nicht handelbar.)

5.4 Risk-Profile T2

```

sl_atr_mult       = 1.5       # tighter – Pumps reverse hart
tp_atr_mult       = 6.0       # höher – Pumps brauchen 1:4 R:R um lohnend zu sein
use_fixed_tp      = false     # Trailing TP, weil Peaks unvorhersehbar
trailing          = aggressiv (Step 0.5 statt 1.0)
breakeven_after_min = 30      # früh auf BE
time_stop_h       = 6         # Pumps sind in 4-6h durch – danach raus
dca_enabled       = false     # KEIN DCA bei T2 (gegen Pump-Reversal-Trap)

```

5.5 Score-Threshold T2

T2 nutzt nicht denselben Score-Filter wie T1, sondern eigene Strategy-Confidence:

```

confidence_min_BULL = 0.60
confidence_min_BEAR = 0.70  # höher gegen False-Pumps in BEAR
confidence_min_HIGH_VOL = 0.55 # erwartet, dafür sind wir hier
testnet_cap         = 0.45  # heute: erlaubt mehr Trades

```

5.6 Anti-Patterns für T2

- **Mean-Reversion-Symbole NIE als T2** — counter-trend ist T1-Domain
- **Stablecoins NIE** (N7.2)
- **Leveraged-Tokens NIE** (Risiko)
- **Symbole mit > 80% 1h-Drawdown** → time-stop sofort

5.7 GUI-Ansicht T2

- KPI-Card "T2 Pump & Dump" eigene Farbe (amber, schon heute), eigene Metriken: open_positions, exposure, time_to_exit_avg, peak_to_close_pct
- Optional: separate "Active Pumps"-Widget mit Live-Tickern der offenen T2-Trades

6. Konfigurations-Modell (technisch)

6.1 Wo lebt die Config

Heute: alles via env-Vars + Hardcoded in `config/settings.py`. Vorgeschlagen: pro-Profil-JSON in `.env-runtime/strategy_profiles.json` (neue Datei).

```
{
  "schema_version": 1,
  "profiles": {
    "t1_core": {
      "active": true,
      "cash_quote_pct": 0.70,
      "max_positions": 6,
      "tier_pcts": {"high": 0.06, "mid": 0.04, "low": 0.02},
      "min_position_usd": 50,
      "max_position_usd": 600,
      "risk": {
        "sl_atr_mult": 2.0,
        "tp_atr_mult": 4.0,
        "use_fixed_tp": true,
        "breakeven_after_h": 60,
        "time_stop_h": 96
      },
      "dca": {"enabled": true, "max_gap_pct": 3, "max_count": 2},
      "thresholds": {"BULL": 7.0, "BEAR": 7.5, "RANGE": 7.5, "HIGH_VOL": 8.0},
      "universe": {
        "min_24h_volume_usd": 5000000,
        "max_spread_bps": 30,
        "include_strategies": [
          "legacy_scanner", "trend_follow", "mean_reversion",
          "vwap_mean_reversion"
        ]
      }
    },
    "t2_pump_dump": {
      "active": true,
      "cash_quote_pct": 0.25,
      "max_positions": 10,
      "tier_pcts": {"high": 0.04, "mid": 0.025, "low": 0.015},
      "min_position_usd": 30,
      "max_position_usd": 250,
      "risk": {
        "sl_atr_mult": 1.5,
        "tp_atr_mult": 6.0,
        "use_fixed_tp": false,
        "trailing_aggression": "high",
        "breakeven_after_min": 30,
        "time_stop_h": 6
      },
      "dca": {"enabled": false},
      "thresholds": {"BULL": 0.60, "BEAR": 0.70, "HIGH_VOL": 0.55},
      "universe": {
        "min_24h_volume_usd": 500000,
        "max_spread_bps": 80,
        "new_listing_boost": 1.0,
        "include_strategies": [
          "breakout", "volatility_sweep",
          "web_channel", "telegram_bot_channel", "t3_forwarded"
        ]
      }
    }
  }
}
```

6.2 Reload-Strategie

- Bot liest beim Startup, cached in-memory
- `apply_profile_testnet` CommandBus-Command (existiert schon!) ist der Hot-Reload-Mechanismus → Operator kann via GUI Profil ändern, Worker setzt das via Postgres, Bot reload-t bei nächstem Cycle
- Audit-Trail: jede Profile-Änderung schreibt in `commands` + `bot_statuses`

6.3 Hard-Boundary

- KEINE Mainnet-Aktivierung
- KEINE Solana-Execution (T3 bleibt Signal-Layer)
- KEINE Backtest-getriebene Tuning-Automatik (Phase STRATEGY-GROUP-CONFIG-1e wäre dafür da, separat)

7. Risk-Budget & Caps

7.1 Gesamt-Bucket

```
Bot-Cash insgesamt:      100 %
T1 Cash-Quote:          70 %
T2 Cash-Quote:          25 %
Reserve (nicht handelbar): 5 %

Maximaler Drawdown pro Tag pro Profil:
T1: 3 % → bot pause + Telegram-Alert
T2: 6 % → bot pause + Telegram-Alert

Maximaler Drawdown gesamt:
Bot: 8 % → SafetyCheck.shutdown_for_today
```

7.2 Per-Trade-Loss-Cap

```
T1 single-trade max-loss: 1.5 % der T1-Quote (= 1.05 % des Gesamtkapitals)
T2 single-trade max-loss: 2.0 % der T2-Quote (= 0.50 % des Gesamtkapitals)
```

7.3 Tagesziel (aspirational, nicht hart)

```
T1 target_daily_pnl: +0.5 % (winrate-getrieben, 6-12 Trades)
T2 target_daily_pnl: +1.5 % (high R:R, 2-5 Trades, viele -1.5 % Stops)
```

8. Konflikt-Resolution: T1 + T2 sehen dasselbe Symbol

Szenario: SOL/USDT zeigt sowohl einen `trend_follow`-Score (→ T1) als auch einen `breakout`-Signal (→ T2).

Regel: das Profil, das **als erstes** ein Signal generiert, bekommt den Symbol-Lock. Das andere überspringt. Das gilt pro-Tick.

Wenn die Position später geschlossen wird, ist das Symbol wieder frei für beide Profile.

Heute schon implementiert: `execute_buy(allow_add=False)` verhindert Doppel-Käufe — was fehlt: explizite Symbol-Lock-Map zwischen den Pipelines, damit T1 nicht im selben Cycle blockiert, wenn T2 erst nach T1 entscheidet.

9. Roll-Out-Plan (Phasen)

Phase	Aufgabe	Dauer	Vorbedingung
STRATEGY-GROUP-CONTRACT-1	strategy_id → strategy_group Mapping (Architektur-Review-Fix)	~30 min Code + Test + Cutover	—
STRATEGY-PROFILE-1a	Plan-Review dieses Dokuments mit Operator	1 Diskussion	Contract-1 done
STRATEGY-PROFILE-1b	Config-Schema-Datei <code>strategy_profiles.json</code> + Loader im Bot	~50 LoC	1a abgenommen
STRATEGY-PROFILE-1c	T1/T2-Pfad-Trennung in main.py + multi_strategy_runner.py (Symbol-Lock, Cash-Quote-Split)	~100 LoC	1b
STRATEGY-PROFILE-1d	Risk-Engine-Adaption (SL/TP/Time-Stop pro Profil)	~80 LoC	1c
STRATEGY-PROFILE-1e	GUI Read-only Profile-Ansicht (zusätzlich zu KPI-Cards)	~120 LoC PHP	1c
STRATEGY-PROFILE-1f	GUI Edit + Audit (apply_profile_testnet erweitern)	~150 LoC	1e
STRATEGY-PROFILE-1g	Kontrolliertes Testnet-Rollout (24-72h passive Beobachtung)	3 Tage	1d
STRATEGY-PROFILE-1h	Backtest pro Profil (braucht OHLCV-CACHE)	separat	1g + OHLCV-CACHE

Hard-Gates (durable)

- `MULTI_STRATEGY_DRY_RUN=false` bleibt **NO-GO** bis 1d done und verifiziert
- Mainnet bleibt **NO-GO** bis 1g done und 30 Tage stabil
- Jede Phase einzeln getestet, einzelnes Operator-GO

10. Verifikations-Tests

Test	Was	Pass-Kriterium
test_profile_schema_loads	strategy_profiles.json wird ohne Fehler geladen	pass
test_t1_only_runs_t1_strategies	MS-Runner aktiviert nur trend_follow / mean_rev / vwap wenn Profil-Filter T1 setzt	pass
test_t2_only_runs_t2_strategies	dito für breakout / volatility_sweep	pass
test_symbol_lock_prevents_doublebuy	T1 hält BTC → T2-Signal auf BTC wird skipped	pass
test_cash_quote_split_respected	Bot hat 1000 USDT cash, T1 Buy-Limit 700, T2 Buy-Limit 250	pass
test_t1_sl_is_2x_atr	T1-Position SL gemessen ist 2 × ATR	pass
test_t2_sl_is_1.5x_atr	T2-Position SL ist 1.5 × ATR	pass
test_t2_no_dca	T2-Symbol unter SL → execute_sell (kein Nachkauf)	pass
test_t2_time_stop_6h	T2-Position offen seit 6h → forced exit	pass
test_daily_dd_pause_t1	T1 Drawdown 3 % → t1-buy blocked, alerts	pass

11. Risiken

Risiko	Schwere	Mitigation
Cash-Quote-Split aushungert ein Profil	mittel	Reserve-Bucket + monatliche Operator-Review der Quoten
Symbol-Lock-Race	niedrig	atomic claim in shared state
Profile-Config-Edit ohne Audit	mittel	apply_profile_testnet via CommandBus erzwingt Audit
Backtest fehlt → Parameter-Drift	mittel	STRATEGY-PROFILE-1h vor jeder Param-Änderung
T2 verbrennt Cash schneller als T1 erholt sich	hoch	Daily-Drawdown-Pause-Gate (6 % T2 → freeze)
Operator versteht 2 Profile nicht	mittel	GUI muss Profile klar trennen + Tooltips

12. Out of Scope

- Echte Solana-Execution (separate Phase)
- Mainnet (Boundary)
- Auto-Tuning / ML-driven config (Phase 1h, eigenständig)
- T3 als echte Strategy-Group (heute nur reserved value, T3-Subsystem forwarded an T2)
- Multi-Exchange (heute nur Binance Spot)

13. STOP

Plan-Dokument. Keine Implementation.

Operator-Decisions vor Phase 1a: 1. Bestätigt das Mapping trend_follow/mean_rev/vwap → T1, breakout/volatility_sweep → T2 ? 2. Bestätigt die Cash-Quote 70/25/5? 3. Bestätigt die Risk-Differenzierung (T1 SL 2×ATR, T2 SL 1.5×ATR, T2 kein DCA, T2 time_stop_h=6)? 4. Bestätigt Hot-Reload via apply_profile_testnet-Command (statt Bot-Restart pro Config-Change)? 5. Bestätigt Reihenfolge der Phasen 1a-1h?

Boundaries: 0× Code, 0× DB, 0× Container, 0× Mainnet, 0× MS-Live-Aktivierung.