

Steve-TradingBot — Strategie- & MS-Dry-Run-Auswertung

Datum: 2026-05-31 **Beobachtungsfenster:** 2026-05-31 12:22 UTC → 20:36 UTC (8 h 14 min) **Bezugspunkt:** RangeTrading-V1 Cutover (commit 1ad93b5) **Bot host-PID:** 984772 (nach MICRO-PRICE-BOT-LOG-EXTEND-1 Recreate 15:57 UTC) **Aktive Pipeline:** Legacy trading/main.py::run_scan_cycle **MS-Pipeline:** MULTI_STRATEGY_DRY_RUN=true (Shadow)

1. Executive Summary

In den 8 h seit RangeTrading-V1-Cutover hat die **Legacy-Pipeline** 7 BUYs und 7 SELLs ausgeführt mit einem kombinierten Netto-PnL von **-6.03 USDT** auf 7 closed Trades. Vier Positionen sind aktuell offen (kombiniert -9 USDT unrealized).

Die **MS-Shadow-Pipeline** hat in derselben Zeit **2 208 Evaluations** über 6 Strategien gelaufen und **32 TRADE_CANDIDATES** produziert — **alle 32 von trend_follow**. Beide neu deployten Strategien (mean_reversion=RangeTrading-V1 und oversold_bounce) haben **0 Candidates** geliefert.

Hauptbefunde: - E1a (Break-Even-Gain) wirkt produktiv: 4 von 7 Closes per break_even_stop mit positivem PnL - E2a Partial-Profit live einmal getriggert: DOGS/USDT +1.48 USDT @ +1.64 %, gefolgt von B-E-Stop auf der Restmenge (+0.87 USDT) — kombinierter DOGS-PnL +2.35 USDT - 2 Volltrades als fixed_stop_loss (BCH -4.65, ENA -6.19) — nicht von E1a abgefangen weil Gain nie über +0.8 % erreicht - RangeTrading-V1 Reject-Pattern ist konzeptionell gesund: 184/316 wegen range_position > 0.40 (Buy nur unten in der Range), 71 wegen Range width too small, 61 wegen RR < 2.0 - OversoldBounce 505/505 Rejects sind alle RSI not oversold enough — Markt-Zustand bietet keine echten Bottoms, Strategie wartet diszipliniert - trend_follow dominiert die MS-Candidates mit TON (26x) und MEME (4x) im STRONG_TREND-Regime — überlappt teilweise mit Legacy-OPPORTUNISTIC-Buys

2. Aktive Pipeline — Trades seit 12:22 UTC

2.1 Trade-Tabelle

Zeit (UTC)	Action	Symbol	Preis	Cost / PnL	Reason
12:05:55	SELL	HBAR/USDT	0.098270	+0.71 USDT (+0.51 %)	break_even_stop
12:40:47	BUY	DOGS/USDT	0.000049	301.37 USDT	T1 CORE-MID
13:20:23	BUY	PEPE/USDT	0.000004	2.00 USDT	T1 OPPORTUNISTIC (Mini-Fill)
13:45:54	PARTIAL 30 %	DOGS/USDT	0.000050	+1.48 USDT (+1.64 %)	partial_profit_e2a_t1
14:02:53	SELL	DOGS/USDT	0.000049	+0.87 USDT (+0.41 %)	break_even_stop
14:17:34	SELL	BCH/USDT	301.100000	-4.65 USDT (-1.54 %)	fixed_stop_loss
14:19:58	SELL	ENA/USDT	0.087700	-6.19 USDT (-3.07 %)	fixed_stop_loss
14:20:12	BUY	SEI/USDT	0.066295	200.50 USDT	T1 OPPORTUNISTIC
14:22:26	SELL	PEPE/USDT	0.000004	-0.07 USDT (-3.64 %)	fixed_stop_loss
14:41:58	BUY	ALGO/USDT	0.128600	200.62 USDT	T1 OPPORTUNISTIC
15:32:31	BUY	WLD/USDT	0.337100	200.84 USDT	T1 OPPORTUNISTIC
15:42:00	SELL	ALGO/USDT	0.129400	+0.85 USDT (+0.42 %)	break_even_stop
15:49:25	BUY	DOGS/USDT	0.000050	203.00 USDT	T1 OPPORTUNISTIC
20:20:31	SELL	WLD/USDT	0.339400	+0.97 USDT (+0.48 %)	break_even_stop
20:35:47	BUY	BARD/USDT	0.196600	200.45 USDT	T1 OPPORTUNISTIC

2.2 Geschlossene Trades — PnL-Summary

Symbol	Roundtrip-PnL	Exit	Hold
HBAR/USDT (pre-cutover)	+0.71 USDT	B-E-Stop	-
DOGS/USDT (1. Run)	+2.35 USDT	Partial +1.48 + B-E +0.87	1 h 22 min
BCH/USDT	-4.65 USDT	Fixed-SL	~6 h 50 min
ENA/USDT	-6.19 USDT	Fixed-SL	~6 h 57 min
PEPE/USDT	-0.07 USDT	Fixed-SL	1 h 2 min
ALGO/USDT	+0.85 USDT	B-E-Stop	1 h 0 min
WLD/USDT	+0.97 USDT	B-E-Stop	4 h 48 min

Netto	-6.03 USDT		
-------	------------	--	--

2.3 Aktuell offene Positionen (Stand 20:36 UTC)

Symbol	Qty	Entry	Current	Cost	PnL %	E2a-Marker
AAVE/USDT	9.85	83.45	81.66	821.82	-2.14 %	-
SEI/USDT	3024.4	0.066295	0.066530	200.50	+0.35 %	-
DOGS/USDT	4 051 919	0.000050	0.000049	203.00	-2.99 %	-
BARD/USDT	1019.6	0.196600	0.196300	200.45	-0.15 %	-
Σ Unrealized				1 425.77 USDT	≈ -9 USDT	-

Cash frei: 8 621.86 USDT · Cooldowns aktiv: 37 Symbole

2.4 E1a- und E2a-Wirkung

- **4 von 7 Closes** wurden per `break_even_stop` mit positivem PnL geschlossen (HBAR, DOGS-Rest, ALGO, WLD) — **57 % E1a-Save-Rate**
- **1 E2a Partial** (DOGS Run 1) → realisierter Gewinn der ersten 30 % bei +1.64 %, danach E1a-Save auf der 70 %-Restmenge
- **3 Closes per Fixed-SL** (BCH, ENA, PEPE) — die alle vor +0.8 % Gain blieben, Risk-Guard blockte korrekt DCA-Rescue in BEAR-Regime
- **0 Phantom-Sells, 0 unknown-Pending-Marker, 0 order_status_unknown** seit P0-Fix-1 (14:11 UTC)

3. MS-Dry-Run — Strategy-Activity seit 12:22 UTC

3.1 Evaluation-Volumen pro Strategie

Strategy	Evaluations	TRADE_CANDIDATES	Conversion
trend_follow	566	32	5.7 %
oversold_bounce	505	0	0 %
vwap_mean_reversion	316	0	0 %
volatility_sweep	316	0	0 %
mean_reversion (RangeTrading-V1)	316	0	0 %
breakout	189	0	0 %
Σ	2 208	32	1.45 %

3.2 Alle 32 TRADE_CANDIDATES — trend_follow only

Symbol	Anzahl	Regime	Final-Score-Bereich
TON/USDT	26	STRONG_TREND	8.54 - 9.43
MEME/USDT	4	STRONG_TREND	9.10
FET/USDT	2	STRONG_TREND / WEAK_TREND	7.52 - 8.37

RR aller 32 Candidates = 2.0 (Min-RR-Schwelle).

3.3 Legacy-Pipeline vs MS-Candidates — Overlap

Die Legacy-Pipeline (OPPORTUNISTIC) hat 6 verschiedene Coins gekauft (DOGS, PEPE, SEI, ALGO, WLD, BARD). **Keiner davon erscheint** in den MS- trend_follow -Candidates. Die beiden Pipelines sind in dieser Beobachtung **disjunkt**: - Legacy nimmt vor allem Micro/Low-Cap-Picks im OPPORTUNISTIC -Tier auf - MS- trend_follow ist auf strenge STRONG_TREND -Top-Liner konzentriert (TON, MEME) - MS-Live wäre also komplementär, nicht redundant

3.4 RangeTrading-V1 (mean_reversion) — Reject-Analyse

316 Evaluations in 8 h, alle in RANGE -Regime, über 20 Symbole. **0 TRADE_CANDIDATES**.

Top-Reject-Reasons:

#	Reject-Reason	Anteil
184	Price in range middle: no edge (range_position > 0.40)	58 %
71	Range width too small: < 1.5 % UND < 1.5 × ATR	22 %

61	Risk/reward below 2.0	19 %
----	-----------------------	------

Interpretation: - 58 % der Coins liegen im Mid-Range — Strategie tut korrekt das, was sie soll: nicht in der Range-Mitte kaufen - 22 % haben zu enge Ranges — bei niedriger Volatilität kein Trade-Setup - 19 % erfüllen $RR < 2.0$ — der altFINS-Style verlangt 2:1 Risk-to-Reward

Verdict: Strategie funktioniert **diszipliniert**. In einem 8 h-Window ohne klaren Range-Boden auf liquiden Pairs ist 0/316 das **erwartete Verhalten** — sie wartet auf echte Setup-Quality. Kein Bug, kein zu enges Threshold.

3.5 OversoldBounce — Reject-Analyse

505 Evaluations, 0 Candidates.

100 % Reject-Reason: RSI not oversold enough: $RSI = <x>$ (need <25 OR $<30+$ reversal)

RSI-Verteilung über Symbole im Window: keine einzige Eval unter $RSI < 30$. Markt-Zustand bietet keine echten Boden-Extreme. Strategie wartet diszipliniert, identisches Verhalten wie in der OVERSOLD-BOUNCE-SHADOW-V1-Erstwoche.

3.6 Symbol-Coverage RangeTrading-V1

20 Symbole evaluiert. Top-Coverage: EUR/USDT (51), ICP (32), PEPE (27), XRP (21), TAO (21), USDE (20), SEI (19), SOL (17), BTC (17), LINK (16).

USDE und EUR sind Stablecoin-Pairs — sollten eigentlich vom T1-Binance-Gate gefiltert sein, aber durch das RANGE-Filter (Stable-Pairs sind per Definition Range) hier evaluiert. **Backlog-Pin Empfehlung:** Stablecoin-Block auch in MS-RangeTrading explizit setzen.

4. Vergleich Pre- vs Post-Cutover

Metrik	Pre-Cutover (STRAT-RECON Phase 1)	Post-Cutover (jetzt)
mean_reversion Evaluations	817 / 9 h	316 / 8 h
mean_reversion TRADE_CANDIDATES	0	0
Reject-Pattern	N7.1-Hard-Gates (RSI<50, EMA200-Veto, Reversal-Pflicht)	altFINS-Hard-Gates (Range-Pos, Width, RR)
Threshold	Score ≥ 7.0	Score ≥ 6.0
LOOKBACK	30 Bars	100 Bars (~4 Tage)

Verdict für RangeTrading-V1: Die strukturelle Re-Architektur hat die Gate-Logik **konzeptionell gesünder** gemacht (range-position + RR-Filter sind diszipliniert), aber das aktuelle Markt-Window bietet weiterhin kein passendes Setup. **Längere Beobachtung** (24–72 h) ist nötig bevor man Score-Cutoff oder Range-Width-Threshold weiter relaxen würde.

5. Handlungsempfehlungen

5.1 Keep

- Legacy-Pipeline bleibt produktiv im Testnet
- MS Dry-Run bleibt aktiv für Beobachtung (`MULTI_STRATEGY_DRY_RUN=true`)
- E1a-Konfiguration (+0.8 % Gain → B-E) ist effektiv — 57 % Save-Rate ist gut für ein BEAR-Window
- RangeTrading-V1 Score-Cutoff 6.0 nicht weiter senken bis ≥ 48 h Beobachtung

5.2 Beobachten (24–72 h)

- AAVE/USDT offene Position -2.14 % — hat Cost 821 USDT, hohes Single-Position-Risk. Wenn SL hit → größter Verlust seit Phase-1
- DOGS/USDT zweiter Run aktuell -2.99 % — sehe ob E1a vor Fixed-SL greift
- MS `trend_follow` 26x TON/USDT-Repeats — hätte als MS-Live-Modus Mehrfach-Buy auf demselben Symbol getriggert (Caveat falls MS-Live aktiviert wird)

5.3 Backlog (separate Phase, kein GO jetzt)

- **MS-STABLECOIN-BLOCK-1** (P3): MS-RangeTrading darf USDE/EUR nicht mehr evaluieren
- **REPEAT-CANDIDATE-DEDUP-1** (P3): Wenn MS aktiviert wird, soll innerhalb einer Cooldown-Periode kein doppelter Buy auf gleichem Symbol passieren
- **STRAT-RECON-PHASE-2** (P2): Cooldown-Recovery R3+R4 — wartet weiter auf Operator-GO

6. Bot Health Snapshot

- Bot host-PID **984772** healthy
 - 0 Tracebacks seit MICRO-PRICE-BOT-LOG-EXTEND-1 Recreate (15:57 UTC)
 - 3-Way MD5 main.py 4c951d4d Repo == Image == Container
 - Watchdog aktiv (cron live)
 - `BINANCE_TESTNET=true` · `MULTI_STRATEGY_DRY_RUN=true` · `LIVE_TRADING_ENABLED=true`
 - Worker `clawbot-worker` Up 6 days, healthy
-

7. STOP

Bericht abgeschlossen. Keine Code-Änderung, keine Empfehlung mit Code-Touch ohne Operator-GO. MS bleibt Shadow.
