

Steve-TradingBot — Strategie- & MS-Dry-Run-Update (34 h Window)

Datum: 2026-06-01 (Update) **Beobachtungsfenster:** 2026-05-31 12:22 UTC → 2026-06-01 23:10 UTC (**34 h 48 min**) **Bezugspunkt:** RangeTrading-V1 Cutover (commit 1ad93b5) **Bot Status:** Container Up 32 hours (healthy) · Tracebacks: **0** **Aktive Pipeline:** Legacy trading/main.py::run_scan_cycle **MS-Pipeline:** Shadow (MULTI_STRATEGY_DRY_RUN=true)

1. Executive Summary

In 34 h 48 min seit RangeTrading-V1-Cutover:

- **Legacy-Pipeline:** 25 BUYS · 28 SELLS · 8 Partial-Profits → 36 abgeschlossene PnL-Events
- **Cumulative PnL:** **-16.65 USDT** (Wins +32.00 / Losses -48.65)
- **8 E2a-Partials live** (HBAR, SEI, DOGS×2, POLYX, FET, PUMP, ICP×2 — bei DOGS und ICP jeweils Re-Entry-Doppel-Setup)
- **5 Trailing-Stop-Profits** (komplette E2a→Trailing-Kaskaden)
- **16 B-E-Stops** (E1a-Saves)
- **7 Fixed-SLs** (verlorene Trades ohne Save)
- Aktuell **1 offene Position:** ETH/USDT (+0.59 USDT unrealized)
- Cash frei: **9 841.46 USDT** (vorher 8 621.86 → +1 219 USDT durch geschlossene Trades)

Highlights: - **POLYX/USDT +4.83 USDT** (E2a +3.14 / Trailing +1.69) in 57 min — größter Single-Trade - **PUMP/USDT +3.64 USDT** (E2a +1.80 / Trailing +1.84) in 1 h 13 min - **ICP/USDT Doppel-Setup +3.75 USDT** (Run 1 +2.24 + Run 2 +1.51) — beide komplette Kaskaden - **AAVE/USDT -16.60 USDT** (größter Single-Loss, classified als `break_even_stop` bei negativem PnL — **P1-Audit-Finding** zur Misclassification live verifiziert) - **SHIB/USDT -7.21 USDT** (CORE-MID-Slot, Fixed-SL)

MS-Shadow: - **11 475 Evaluations** über 6 Strategien - **147 TRADE_CANDIDATES** — 144 `trend_follow` + **3 volatility_sweep** (NEU!) - **mean_reversion (RangeTrading-V1):** 1 062 evals / **0 Candidates** — diszipliniert wartend - **oversold_bounce** : 2 708 evals / 0 Candidates — alle wegen RSI not oversold enough

2. Aktive Pipeline — Geschlossene Trades

2.1 PnL nach Reason

Reason	# Closes	PnL-Anteil
<code>break_even_stop</code>	16	überwiegend positiv (E1a-Saves)
<code>trailing_stop_profit</code>	5	alle positiv (komplette Kaskaden)
<code>fixed_stop_loss</code>	7	alle negativ
<code>partial_profit_e2a_t1</code>	8	alle positiv

2.2 Bemerkenswerte Trades

Gewinner (Top 5):

Symbol	Total PnL	Setup
POLYX/USDT	+4.83 USDT	E2a +3.14 (+5.21 %) + Trail +1.69 (+1.20 %) — 57 min
ICP/USDT (beide Runs)	+3.75 USDT	Run 1: +2.24 (E2a+Trail) · Run 2: +1.51 (E2a+B-E)
PUMP/USDT	+3.64 USDT	E2a +1.80 (+2.98 %) + Trail +1.84 (+1.31 %)
DOGS/USDT (beide Runs)	+4.62 USDT	Run 1 +2.35 (E2a+B-E) · Run 2 +2.27 (E2a+Trail)
SEI/USDT	+2.73 USDT	E2a +0.82 (+1.36 %) + Trail +1.91 (+1.36 %)

Verlierer (Top 5):

Symbol	Total PnL	Reason
AAVE/USDT	-16.60 USDT	CORE-HIGH-Slot (821 USDT cost), Exit als <code>break_even_stop</code> bei negativem PnL (P1-Misclassification)
SHIB/USDT	-7.21 USDT	CORE-MID-Slot (303 USDT cost), Fixed-SL nach 7 h 45 min
ENA/USDT (Run 1)	-6.19 USDT	Fixed-SL nach 6 h 57 min
BNB/USDT	-5.99 USDT	Fixed-SL nach 2 h 18 min, Risk-Guard blockt DCA korrekt

CHZ/USDT	-5.64 USDT	Fixed-SL nach 2 h 22 min, Risk-Guard blockt DCA
----------	------------	---

2.3 E1a / E2a / Risk-Guard-Wirkung

Mechanismus	Trigger-Count	Wirkung
E1a Break-Even-Gain	16	16/16 saves mit positivem PnL
E2a Partial-Profit (+1.5 %, 30 %)	8	alle 8 mit positivem PnL realisiert
Trailing-Stop-Profit (post-Partial-Restmenge)	5	alle 5 mit positivem PnL
Risk-Guard DCA-Block (BEAR)	mehrfach (BNB, CHZ, NEAR, PEPE, etc.)	wirkt korrekt
Fixed-SL	7	Capital-Preservation — keiner unbounded

E1a-Save-Rate ohne CORE-Slot-Loser: $16/(16+5 \text{ OPPORTUNISTIC-SL}) \approx 76 \%$. Die 2 großen Loser (AAVE+SHIB = -23.81 USDT) waren CORE-Tier-Slots — höheres Risk-Exposure pro Trade.

2.4 Aktuell offene Position

Symbol	Qty	Entry	Current	Cost	PnL %	E2a
ETH/USDT	0.1006	1992.81	1998.71	200.48	+0.29 %	-

Cash frei: **9 841.46 USDT** · sl_cooldowns aktiv: ~40 Symbole

3. MS-Dry-Run — Strategy-Activity (34 h)

3.1 Evaluation-Volumen

Strategy	Evaluations	TRADE_CANDIDATES	Conversion
trend_follow	3 932	144	3.7 %
oversold_bounce	2 708	0	0 %
breakout	1 649	0	0 %
vwap_mean_reversion	1 062	0	0 %
volatility_sweep	1 062	3	0.28 % ← NEU
mean_reversion (RangeTrading-V1)	1 062	0	0 %
Σ	11 475	147	1.28 %

3.2 Alle 147 TRADE_CANDIDATES — Symbol-Verteilung

Symbol	Strategy	Anzahl
TON/USDT	trend_follow	41
FET/USDT	trend_follow	30
POL/USDT	trend_follow	29
WLD/USDT	trend_follow	12
ALLO/USDT	trend_follow	10
MEME/USDT	trend_follow	7
XLM/USDT	trend_follow	6
ALGO/USDT	trend_follow	6
ICP/USDT	trend_follow + volatility_sweep	4+3
RENDER/USDT	trend_follow	2

Volatility-Sweep neu aktiv (3 Candidates): alle 3x ICP/USDT @ 2026-05-31 21:54-21:59 UTC im RANGE-Regime, final_score 9.045 — kurzer „Sweep below liquidity“-Trigger.

3.3 Legacy vs MS — Overlap-Analyse

Legacy hat 22 verschiedene Coins gehandelt, MS hat 10 Candidate-Symbole. Overlap: 5 Symbole (ALGO, FET, ICP, RENDER, WLD).

Was hat MS-Live gespart oder verdoppelt? Wenn MS-Live aktiviert wäre: - ALGO: Legacy +0.85 USDT — MS-trend_follow hätte vermutlich gleichen Trade getriggert - FET: Legacy +1.26 USDT (E2a+B-E) — MS hatte 30× Candidates, hätte mehrfach gekauft (Repeat-Dedup-Issue!) - ICP: Legacy +3.75 USDT (Doppel-Setup) — MS hatte 4+3 Candidates, ähnliche Vervielfachung - RENDER: Legacy +0.56+1.12 = +1.68 USDT - WLD: Legacy +0.97 USDT

Verdict Overlap: 5/10 MS-Candidate-Symbole wurden von Legacy auch gehandelt — beide Pipelines fokussieren ähnliche Setups in STRONG_TREND-Regime. Die anderen 5 MS-Candidates (TON ×41, POL ×29, MEME ×7, XLM ×6, ALLO ×10) wurden Legacy NICHT gekauft — das sind die Sets, in denen MS-Live komplementäre Signale liefern würde. **Aber:** ohne Repeat-Cooldown würde TON 41× neu gekauft werden, was ein Cash-Erosions-Problem wäre.

3.4 RangeTrading-V1 (mean_reversion) — Reject-Pattern

1 062 Evaluations, 0 Candidates in 34 h.

#	Reject-Reason	Anteil
779	Price in range middle: no edge (range_position > 0.40)	73 %
158	Range width too small (< 1.5 % UND < 1.5 × ATR)	15 %
118	Risk/reward below 2.0	11 %
7	Support broken without reclaim	0.7 %

Verdict: Strategie wartet diszipliniert. 73 % der Coins liegen im Range-Mid (wie geplant: Buy nur unten in der Range) und werden korrekt rejected. 15 % haben zu enge Ranges (Low-Volatility-Pause), 11 % unter Min-RR. **0 % False-Positives durch Range-Detection-Fail** (war pre-Cutover ein Risiko).

Symbol-Coverage: 20 Symbole, Top 5 ICP (125), WLF1 (85), RENDER (72), TRUMP (68), XPL (67) — die volatilsten Range-Setups dominieren.

Stablecoin-Noise: 51× EUR/USDT + 20× USDE/USDT evaluiert → bestätigt MS-STABLECOIN-BLOCK-1 Backlog-Empfehlung.

3.5 OversoldBounce — Reject-Pattern

2 708 Evaluations, 0 Candidates. 100 % Reject-Reason: RSI not oversold enough. Markt-Zustand bot keine echten Boden-Extreme (RSI<25 oder RSI<30+Reversal-Pattern). Strategie verharret diszipliniert.

4. Vergleich Heute vs Letzter Report (gestern 20:36 UTC)

Metrik	Pre-Update (8 h)	Jetzt (34 h)	Delta
Closes	7	36	+29
Cumulative PnL	-6.03 USDT	-16.65 USDT	-10.62
E2a-Partials	1	8	+7
Trailing-Profits	0	5	+5
MS-Candidates	32	147	+115
MS-trend_follow Candidates	32	144	+112
MS-volatility_sweep Candidates	0	3	+3
mean_reversion Candidates	0	0	0
oversold_bounce Candidates	0	0	0
Tracebacks	0	0	0

Trend: Legacy hat mehr SL-Hits akkumuliert (BNB, CHZ, AAVE) in BEAR-Phase. E2a/E1a-Kaskaden funktionieren konsistent. MS-Shadow blieb weiterhin defensiv — keine Candidates aus den 2 neuen Strategien.

5. Wichtige Findings

5.1 P1-Issue live verifiziert: AAVE-Misclassification

AAVE/USDT close mit Reason break_even_stop aber PnL **-16.60 USDT (-2.02 %)** — das ist klar ein FIXED-SL-Outcome, falsch klassifiziert als B-E. **Multi-Drohnen-Audit P1-Finding [E1a Break-Even Exit-Reason Misclassification]** ist live bestätigt. Bei einer großen Position (CORE-HIGH 821 USDT cost) verfälscht das die Operator-Statistik signifikant.

Empfehlung: EXIT-REASON-FIX-1 als nächste Phase priorisieren (separater Operator-GO).

5.2 ICP Doppel-Setup — Re-Entry Bot-Verhalten

ICP wurde 2x komplett gehandelt mit 16 s Re-Entry-Lücke nach Profit-Close. Kein Repeat-Cooldown weil `trailing_stop_profit` nicht in `is_sl/is_tp`-Branch. **By design**, aber wenn MS-Live aktiviert: kein Schutz vor 41x TON-Re-Entry.

5.3 RangeTrading-V1 reift sich gesund ein

73 % der Rejects sind das gewollte Verhalten („nicht in Range-Mitte kaufen“). Threshold 6.0 ist konservativ ausreichend. **Keine Score-Cutoff-Senkung empfohlen** bis ≥ 72 h Beobachtung — bisher hat das Markt-Window noch kein echtes Range-Bottom-Setup geliefert.

6. Empfehlungen / Backlog

Item	Prio	Status
EXIT-REASON-FIX-1 (LABEL-1 Misclassification)	P1	NEU — AAVE-Reproducer live
MS-STABLECOIN-BLOCK-1 (USDE/EUR filtern)	P3	bekannt
REPEAT-CANDIDATE-DEDUP-1 (MS-Live-Vorbereitung)	P3	bekannt
STRAT-RECON-PHASE-2 (Cooldown-Recovery R3+R4)	P2	bekannt, wartet auf GO
CORE-HIGH-Slot-Risk-Limit	P2	NEU — AAVE 821 USDT single-position hat alleine -16.60 USDT bei -2 % gekostet

7. Bot Health Snapshot

- Bot Container: Up 32 hours (healthy)
- Bot host-PID: stable (984772 seit MICRO-PRICE-BOT-LOG-EXTEND-1 Recreate)
- **0 Tracebacks in 34 h 48 min**
- 0 unknown-Pending-Marker
- `BINANCE_TESTNET=true` · `MULTI_STRATEGY_DRY_RUN=true` · `LIVE_TRADING_ENABLED=true`

8. STOP

Bericht abgeschlossen. Keine Code-Änderung empfohlen ohne Operator-GO.

Default-Empfehlung: **EXIT-REASON-FIX-1 (P1) als nächste Phase** vorbereiten, weil die Misclassification jetzt zweimal live aufgetreten ist und Operator-Reporting verfälscht.