

Strategy Interim Report – Execution Mode Corrected

Datum: 2026-05-14 19:32 UTC | Repo: Steve-TradingBot | master HEAD: 431ada5 (EXEC-MODE-LABEL-1) | Bot-Image: f6f11397f791 | Modus: EXCHANGE_TESTNET | Scope: **READ-ONLY** | Strategieänderung: **NO-GO**

Executive Summary

Der bisherige Strategy-/Loss-Audit hatte zwei strukturelle Fehler, die durch EXEC-MODE-1 + EXEC-MODE-LABEL-1 jetzt aufgeklärt sind:

- Trades waren keine Paper-Simulation.** Trotz Variable-Name `paper_trader` und DB-source-Werten `paper_trader.update_prices.close` lief seit "Phase L" **LiveTrader gegen Binance Testnet** mit echten Testnet-API-Orders. Sämtliche Strategie-Kennzahlen sind also gegen echte Exchange-Execution-Flows entstanden — inklusive Slippage, Spreads und Order-Latenz.
- POS-CAP-1 "42 offene Positionen" war Telemetry-Bug**, nicht Risk-Bruch. Aktuell **5 echte offene Positionen** (Cap=6 RANGING).

Kernbefund unverändert kritisch: Profit Factor 0.548, Netto-PnL **-\$191.21** über 53 closed trades / 6 Tage. Loss-Asymmetrie **2.38x** (Avg Loss -\$18.41 vs Avg Win +\$7.74). Exit-Reason-Verteilung extrem schief: **96.2% via stop_loss** Label — davon aber 28 profitable und 23 verlustig → Sammellabel verbirgt Trailing-Stop-Gewinne. **LABEL-1 + DATA-LINK-1 sind harte Voraussetzungen für belastbare Attribution.**

GO/NO-GO für Strategieänderungen: **NO-GO**. Erst LABEL-1 (Subtypen) + DATA-LINK-1 (regime/strategy attribution) lösen, dann saubere OHLCV-Backtest-Analyse. Bis dahin keine Parameter-Tuning.

1. Live-State

Item	Wert
master HEAD	431ada51c559acb3804f1e88fdddc65bb3619f5a
git status	clean
Bot	host-PID 3700125, healthy, restartCount 0, image f6f11397f791
Bot main.py	container-PID 69 (Watchdog-Spawn 19:10:14 UTC mit deprecated --paper -Flag)
Worker	host-PID 3430424, restartCount 0
GUI	host-PID 3431767, HTTPS /admin/login HTTP 200
BINANCE_TESTNET	true
cmd 13	cancelled
managed_proposals / history	0 / 0
decision_logs / 5min	+52 (latest 19:32:10+)
position_snapshots / 5min	+10
regime_logs latest	19:31:46
bot_statuses / 2min	+5
0 Tracebacks seit 19:10	✓
Aktuelles Regime	RANGING (Min Score 6.5, Bias NEUTRAL)
effective_position_cap	6 (regime=6, global_max=10, source=regime)
Fresh open positions	5 (BERA, SXT, FIL, BB, ASTER)
Nominal Wert	\$2,526.70
Unrealized PnL	-\$35.38

2. Execution-Mode-Korrektur

Item	Vorher (falsch interpretiert)	Jetzt (korrekt)
paper_trader Variable	"Bot macht Paper-Simulation"	Legacy-Variable-Name; war LiveTrader() -Instanz (jetzt umbenannt zu live_trader)
DB-source paper_trader.update_prices.close	"Paper-Close"	LiveTrader-Close gegen Binance Testnet API (historisch Label, neue Writes ab 19:11 UTC: live_trader.update_prices.close)
Bot-Modus	"Paper Trading"	EXCHANGE_TESTNET (Binance-Testnet-API mit echten Orders/Slippage/Spread)
--paper CLI	"aktiviert Paper-Modus"	Deprecated seit Phase L; no-op; Deprecation-Warning seit EXEC-MODE-LABEL-1 gelogged
Label "TESTNET LIVE"	"missverständlich"	inhaltlich korrekt — echte Testnet-Orders, daher "LIVE" gerechtfertigt
Reine Paper-Simulation aktiv?	unklar	Nein , LIVE_TRADING_ENABLED=false → bot exits (Phase L)
Mainnet erreichbar?	unklar	Nein, harte Guards: runtime_config_writer.py:413 , proposal_engine.py:81/167 , BINANCE_TESTNET=true gepinnt

Implikation für Strategie-Kennzahlen: Alle PnL-Werte enthalten **echte Binance-Testnet-Fees + Slippage** — Strategie hat den realistischeren Stress-Test bereits durchlaufen.

3. Strategy-Kennzahlen

Basis: 53 closed trades, Zeitraum 2026-05-08 → 2026-05-14.

Metric	Wert	Bewertung
Total closed trades	53	6-Tages-Sample, klein aber aussagekräftig
Wins / Losses	30 / 23	Winrate 56.6%
Netto-PnL	-\$191.21	negativ trotz hoher Winrate
Gross Win	+\$232.11	
Gross Loss	-\$423.32	
Profit Factor	0.548	KRITISCH < 1.0 → System bleed
Avg Win	+\$7.74	
Avg Loss	-\$18.41	
Median Win	+\$6.04	
Median Loss	-\$19.87	
Loss/Win Ratio (Avg)	2.38x	Stop-Levels zu weit oder Wins zu früh genommen
Loss/Win Ratio (Median)	3.29x	Asymmetrie noch deutlicher
Größter Loss	-\$37.17	CHIP/USDT
Größter Win	+\$24.22	DOGE/USDT
Max-Win / Max-Loss Ratio	0.65	Ein einziger Loss übersteigt den besten Win

Loss/Win-Verteilung

Bucket	n
Wins < \$5 (tiny)	12
Wins \$5-15 (small)	13
Wins ≥ \$15 (large)	5
Losses < \$5 (tiny)	7
Losses \$5-15 (small)	1
Losses \$15-25 (medium)	7
Losses ≥ \$25 (large)	8

Linke Verteilungs-Schwanz (Losses) hat **8 große Losses ≥ \$25**, rechte Seite nur **5 Wins ≥ \$15** und **0 Wins ≥ \$25**. Trail-/Stop-Truncation funktioniert in Verlust-Richtung nicht.

4. Datenqualitäts-Matrix

Datenpunkt	Status	Impact
trade_logs.decision_id	53/53 = 100% NULL	DATA-LINK-1 offen: kein JOIN auf decision_logs → kein Regime-/Strategie-Attribution möglich
trade_logs.opened_at	53/53 NULL	duration_seconds fehlt → kein Hold-Time-Profil
trade_logs.strategy_id	leer	keine Strategie-Bucket-Auswertung
trade_logs.mode	"paper" (legacy)	irreführend (= EXCHANGE_TESTNET); neue rows ab Bot-Restart noch zu prüfen
trade_logs.environment	"testnet"	korrekt
exit_reason='stop_loss'	51/53 = 96.2%	LABEL-1 offen: enthält 28 profitable + 23 loss-making Trades → Sammellabel
exit_reason='take_profit'	2/53 = 3.8%	extrem selten, TPs werden durch Trailing vorher angefahren
Telemetry-Lücke 07:20-13:31 UTC	decision_logs in dem Fenster: nur 27 rows (vs typische ~150/5min)	TELE-1 Outage bestätigt
position_snapshots.status='closed'	3 rows total (DATA-CLEANUP-1 live)	2x paper_trader.update_prices.close (historisch) + 1x live_trader.update_prices.close (ab 19:26 UTC, post-EXEC-MODE-LABEL-1) — source-string-Übergang funktioniert
Stale "42 open positions"	korrigiert	aktuell 5 echte fresh, Cap=6 RANGING ✓

5. Top Losses + Top Wins

Top 10 Losses

Symbol	Closed	PnL	Reason
CHIP/USDT	2026-05-13 14:02	-\$37.17	stop_loss
ONDO/USDT	2026-05-09 08:46	-\$35.56	stop_loss
FIL/USDT	2026-05-10 20:46	-\$35.35	stop_loss
SOLV/USDT	2026-05-14 05:07	-\$35.27	stop_loss
CHIP/USDT	2026-05-10 06:01	-\$34.14	stop_loss
ONDO/USDT	2026-05-13 13:46	-\$28.75	stop_loss
NEAR/USDT	2026-05-11 04:21	-\$25.58	stop_loss
IOTA/USDT	2026-05-12 15:28	-\$25.27	stop_loss
WLD/USDT	2026-05-13 13:36	-\$24.38	stop_loss
TNSR/USDT	2026-05-13 12:39	-\$21.25	stop_loss

Cluster-Konzentration: 4 von 10 Top-Losses am 2026-05-13 (Tagesregime?). CHIP + ONDO doppelt im Top-10. Wiederholtes Re-Entry nach Verlust.

Top 10 Wins

Symbol	Closed	PnL	Reason
DOGE/USDT	2026-05-11 00:12	+\$24.22	stop_loss (Trailing-Profit)
ENA/USDT	2026-05-08 07:11	+\$23.06	stop_loss (Trailing-Profit)
ENA/USDT	2026-05-10 18:09	+\$19.71	stop_loss (Trailing-Profit)
DOGE/USDT	2026-05-14 18:36	+\$17.99	stop_loss (Trailing-Profit)
NEAR/USDT	2026-05-12 08:09	+\$15.73	stop_loss (Trailing-Profit)
TON/USDT	2026-05-11 20:34	+\$10.83	stop_loss (Trailing-Profit)
LINK/USDT	2026-05-08 18:32	+\$10.38	stop_loss (Trailing-Profit)
SOL/USDT	2026-05-14 16:21	+\$8.23	stop_loss (Trailing-Profit)
UNI/USDT	2026-05-14 15:39	+\$8.17	stop_loss (Trailing-Profit)
TAO/USDT	2026-05-10 13:41	+\$8.06	take_profit (einer von nur 2 echten TPs)

9 von 10 Top-Wins haben exit_reason='stop_loss' — das sind Trailing-Stops, die in Profit ausgelöst haben. Bestätigt LABEL-1-Notwendigkeit.

6. BEAR-Regime-Auswertung

NICHT belastbar wegen DATA-LINK-1 offen.

Versuch	Ergebnis
trade_logs JOIN decision_logs ON decision_id	53/53 NULL — JOIN liefert keine Zeilen
regime column auf trade_logs	nicht vorhanden im Schema
Heuristik via opened_at + Zeitfenster + regime_logs	opened_at ist 53/53 NULL → nicht möglich
Vorheriger POS-CAP-1 Befund "BEAR-PnL dominant"	nicht reproduzierbar ohne Attribution

Aussage "BEAR-Regime ist Hauptverlustquelle" derzeit **NICHT belastbar**. Notwendig: DATA-LINK-1 + ergänzendes regime_at_open -Feld auf trade_logs ODER zeitsynchrone Verknüpfung über closed_at ± Δt mit regime_logs .

7. Stop-Loss-/Trailing-Verdacht

Verdacht	Evidenz	Bewertung
Stop-Loss-Quote ungewöhnlich hoch	96.2% aller Exits	bestätigt
Sammellabel "stop_loss" verbirgt Trailing-TPs	28 profitable stop_loss Closes / 51 = 54.9%	bestätigt
Trailing-Trigger zu eng (frühe Profit-Mitnahme)	9/10 Top-Wins via stop_loss, größter Win nur +\$24	hochwahrscheinlich
Fixed Stop-Loss zu weit (Loss-Truncation fehlt)	Avg Loss -\$18.41, 8 Losses ≥ \$25	bestätigt
Echte take_profit -Exits werden kaum getriggert	2/53 = 3.8%	bestätigt — TP-Level vermutlich zu weit weg, Trail nimmt vorher
Re-Entry-Verlust-Loop	CHIP 2x / ONDO 2x im Top-10-Losses	Verdacht (klein, nicht final)

Stop/Trailing/TP-System ist verdächtig — aber gezielte Diagnose erst nach LABEL-1.

8. Performance-Fazit

Frage	Antwort	Caveat
Profit Factor weiterhin kritisch?	Ja, 0.548 (Bleed)	belastbar
Verluste größer als Gewinne?	Ja, 2.38x Avg, 3.29x Median	belastbar
BEAR-Regime Hauptverlustquelle?	unklar	nicht belastbar — DATA-LINK-1 offen
Stop/Trailing/TP-System verdächtig?	Ja (Sammellabel + Asymmetrie)	belastbar, aber Diagnose-Tiefe braucht LABEL-1
Belastbare Aussagen	Profit Factor, Asymmetrie, Sammellabel-Problem, fresh-positions-Cap-konform	✓
Eingeschränkte Aussagen	Regime-Attribution, Strategy-Attribution, Hold-Time-Profil, Trailing-Trigger-Verteilung	DATA-LINK-1 + LABEL-1 nötig

9. Backlog-Priorisierung

P0/P1 — Voraussetzungen für saubere Strategie-Diagnose

ID	Inhalt	Begründung
LABEL-1 (P0)	exit_reason='stop_loss' Subtypen trennen: fixed_stop_loss, trailing_stop_profit, panic_stop, time_stop, ...	96% aller Exits unter einem Label → keine valide Diagnose
DATA-LINK-1 (P0)	trade_logs.decision_id befüllen + opened_at setzen; ggf. zusätzliches regime_at_open -Feld	100% NULL blockiert jede Attribution
TRAIL-1 (P1)	Trailing-Kalibrierung review (Median-Win +\$6 deutet auf zu enges Trailing)	nach LABEL-1 mit echten Trailing-Daten
STRATEGY-BACKTEST-OHLCV (P1)	OHLCV-basierter Backtest erst nach LABEL-1 + DATA-LINK-1 mit korrekter Attribution	aktuell wäre Backtest gegen unklare Labels

P2

ID	Inhalt
EXEC-MODE-LABEL-2	Tests/Docs/PaperBalanceProvider-Renamings (out-of-scope EXEC-MODE-LABEL-1)
WATCHDOG-PAPER-FLAG-CLEANUP	bot_watchdog.sh:34 --paper entfernen
GUI-DESIGN-1a	Theme-only (datengetriebene Widgets erst nach LABEL/DATA-LINK)
SNAPSHOT-LIFECYCLE-2	stale-rows < 13:31 cleanup
SNAPSHOT-LIFECYCLE-3	SQL-View v_current_open_positions
GUI-COMPOSE-1	orphan run → managed
COMMAND-BUS-V6 / MH-1-ENABLE	bewusst getrennt: erst Strategy stabil, dann Feature-Schicht

P3

ID	Inhalt
SOT-1d-FU1	clawbot-openclaw Deklaration aus compose entfernen nach 7d
WATCHDOG-FREEZE-PATTERN	Marker-File statt crontab-Edit

10. GO/NO-GO für Strategieänderungen

NO-GO — keine Parameter-Tuning, kein Strategie-Code-Change in dieser Phase.

Begründung:

- Profit-Factor 0.548 ist gemessen, aber die Trail-/Stop-Diagnose ist von Sammellabel verzerrt.
- Ohne LABEL-1 würde Trail-/Stop-Parameter-Anpassung gegen schlechte Daten optimieren.
- DATA-LINK-1 fehlt — regime-getriebene Parameter-Splits sind nicht messbar.

Empfohlene Sequenz:

1. LABEL-1 umsetzen (Code-Touch in `paper_trade.py` / `live_trade.py` + neue `exit_reason`-Subtypen).
2. DATA-LINK-1 umsetzen (`decision_id` + `opened_at` befüllen).
3. Wartezeit ~3-5 Tage für neue Datenakkumulation mit korrekten Labels.
4. OHLCV-Backtest + TRAIL-1 Diagnose mit dann sauberen Daten.
5. Operator-Decision für Parameter-Anpassung.

11. Boundaries

Boundary	Status
Kein Code	✓
Keine Strategieparameter	✓
Keine Orders	✓
Keine DB-Writes	✓ (nur SELECTs)
Kein Restart	✓
Kein Mainnet	✓ BINANCE_TESTNET=true
Keine Secrets	✓
Kein env dump	✓
Kein compose config mit Secrets	✓
Kein Push	✓ master 431ada5 unverändert

STOP — Operator-GO für nächste Phase (Empfehlung: **LABEL-1**).