

Trading Intelligence OS

Dieses Benutzerhandbuch beschreibt die Bedienlogik des Trading Intelligence OS auf Basis der kontrollierten Version 5.3.11 R2. Es trennt den Handelsarbeitsablauf bewusst vom technischen Deploymentpfad. P0 schafft belastbare Entscheidungsfähigkeit, P1 prüft den Edge im Shadow-/Paper-Betrieb; Live-Ausführung, Order-Aktionen, erzwungenes Lernen, PRT-Promotion und Änderungen an Brokerrechten bleiben im aktuellen P0/P1-Kanal gesperrt.



Arbeitsstand: 5.3.11 R2 · P0/P1-Härtung

1. Schnellorientierung

Der Prospekt erklärt das Projekt nach außen. Dieses Handbuch erklärt die Arbeit darin. Die zentrale Reihenfolge lautet: Datenqualität prüfen, P0-Entscheidung ableiten, P1-Evidenz aufbauen. Eine erfolgreiche technische Vorprüfung oder ein grüner Datenpfad ist keine Freigabe für Live-Orders.

- 1 Betriebszentrale öffnen und Daten-, Provider- und Betriebsstatus prüfen.
- 2 Quotes/Bars und Chartfrische prüfen; bei unvollständiger Datenlage keine scheinbar präzise Trade-Entscheidung ableiten.
- 3 Frühchancen, Ranking, Prognosen und Chart-Signale gemeinsam mit den Risikogates lesen.
- 4 Ergebnis als TRADE_CANDIDATE oder NO_TRADE dokumentieren; Nicht-Handeln ist ein reguläres Ergebnis.
- 5 Trade-Kandidaten ausschließlich im Shadow-/Paper-Pfad planen und mit Einstieg, Stop, Ziel, Größe, Kostenannahmen und Risikobudget dokumentieren.
- 6 Outcomes plausibilisieren und P1-Evidenz über Realisierbarkeit, Kalibrierung, Holdout/Walk-forward sowie Kosten/Slippage aufbauen.
- 7 IBKR-/Live-Orderpfad erst nach gesonderter P2-Freigabe öffnen.

Statusgrenze

Version 5.3.11 R2 ist der aktuelle kontrollierte Source-/Produktionsbasis-Stand, aber keine Freigabe für automatischen Live-Handel. Im P0/P1-Kanal sind Live Execution, Order-Aktionen, erzwungenes Lernen, PRT-Promotion und Änderungen an Brokerrechten ausdrücklich gesperrt. Der neue Deployment-Control-Plane-Code dient Audit und Staging; eine Produktionsmutation ist damit nicht autorisiert.

2. P0 bis P3: Reihenfolge vor Funktionsfülle

P0 · Entscheidungsfähig werden

Verlässliche Quotes/Bars, Charts, Rankings, Prognosen und Risk Gates müssen ein nachvollziehbares TRADE_CANDIDATE oder NO_TRADE ermöglichen.

P1 · Edge belegen

Paper-/Shadow-Trades, Outcomes, Realisierbarkeit, Holdout/Walk-forward, Kalibrierung sowie Slippage-/Kostenmodellierung müssen zeigen, ob der Edge außerhalb einer bloßen Modellannahme trägt.

P2 · Kontrolliert monetarisieren

IBKR-Pilot mit realen Bid/Ask-/Fill-Daten, realen Gebühren und eng begrenzter Orderautorisierung hinter einem Risk Governor.

P3 · Skalieren und automatisieren

Portfolio-Stress, Faktor-/Korrelationsmodelle, dynamische Kapitalallokation, kontrolliertes Lernen und erst danach Auto-Execution.

Priorisierungsregel

Technische Schwere allein bestimmt nicht die Reihenfolge. Vorrang hat der Engpass, der den schnellsten vertretbaren Weg zu einer belastbaren Monetarisierung blockiert.

3. Wo finde ich was?

1. Betriebszentrale / Dashboard

Wo: Navigation: Start und täglicher Handel > Dashboard bzw. Betriebszentrale

Warum: Hier beginnt der tägliche Arbeitsablauf. Der Bereich bündelt Systemzustand, Datenlage und die wichtigsten Handlungsindikatoren.

Wann: Immer zuerst, bevor Prognosen oder Signale als Entscheidungsgrundlage gelesen werden.

Wie:

- System-/Providerstatus kontrollieren.
- Quote-/Bar-Frische und relevante Daten-Gates prüfen.
- Betriebsmodus und Blocker lesen.
- Nur bei gesunder Grundlage in Signale, Ranking und Prognosen wechseln.

Grenze/Hinweis: P0 verlangt Entscheidungsfähigkeit; ein laufender Datenpfad allein ist noch kein Trade-Kandidat.

2. Prognosen

Wo: Navigation: Start und täglicher Handel > Prognosen

Warum: Prognosen liefern eine Richtungs- bzw. Erwartungssicht. Sie sind ein Analysebaustein, nicht alleinige Kaufentscheidung.

Wann: Wenn ein Instrument nach Datenprüfung und Watchlist-Selektion vertieft werden soll.

Wie:

- Instrument auswählen.
- Prognosehorizont und Aktualität prüfen.
- Richtungsprognose getrennt von Kalibrierung und Trade-R lesen.
- Nur mit Signal-, Risiko- und Datenstatus zusammen bewerten.

3. Frühchancen

Wo: Navigation: Start und täglicher Handel > Frühchancen

Warum: Der Bereich priorisiert frühe Setups, bevor sie zu einem vollständigen Trade-Plan werden.

Wann: Zur Ideenfindung und Priorisierung einer kleinen Zahl weiter zu prüfender Kandidaten.

Wie:

- Rangliste öffnen.
- Datenstatus des Kandidaten prüfen.
- Begründung/Signalquellen lesen.
- Kandidaten in Watchlist übernehmen oder verwerfen.

4. Chart-Signale

Wo: Navigation: Start und täglicher Handel > Chart-Signale

Warum: Chart-Signale zeigen technische Muster und Zustände. Sie ergänzen Prognose und Markt-/News-Kontext.

Wann: Wenn ein Kandidat technisch bestätigt oder verworfen werden soll.

Wie:

- Instrument und Zeitfenster wählen.
- Bar-Frische prüfen.
- Signale mit Prognose und Risiko vergleichen.
- Bei BLOCKED_BARS oder fehlenden Charts keine Scheingenauigkeit ableiten.

Grenze/Hinweis: Der kanonische Bars-/Chart-Pfad ist vom PRT-Shadow-Pfad getrennt.

5. Watchlist

Wo: Navigation: Start und täglicher Handel > Watchlist

Warum: Die Watchlist begrenzt den Arbeitsraum auf Instrumente, die tatsächlich beobachtet werden sollen.

Wann: Nach der Erstselektion und vor detaillierter Trade-Planung.

Wie:

- Instrument aufnehmen oder entfernen.
- Beobachtungsgrund festhalten.
- Aktualität und Datenabdeckung kontrollieren.
- Nur aktive Kandidaten in nachfolgende Analyse übernehmen.

6. Portfolio

Wo: Navigation: Start und täglicher Handel > Portfolio

Warum: Portfolio trennt bestehende Exponierung von neuen Ideen. Dadurch wird eine gute Einzelidee nicht isoliert vom Gesamtrisiko betrachtet.

Wann: Vor jeder Positionsentscheidung und zur laufenden Bestandskontrolle.

Wie:

- Bestehende Positionen prüfen.
- Exposure und verfügbare Mittel erfassen.
- Neuen Trade gegen vorhandene Konzentrationen prüfen.
- Ergebnis in Risiko übernehmen.

7. Risiko

Wo: Navigation: Start und täglicher Handel > Risiko

Warum: Hier wird aus einer Analyse eine begrenzte, verantwortbare Position. Kapitalerhalt steht vor Renditedruck.

Wann: Unmittelbar vor jeder geplanten Ausführung bzw. Shadow-Order.

Wie:

- Risikobudget festlegen.
- Einstieg, Stop und Ziel prüfen.
- Positionsgröße aus Risiko und Distanz ableiten.
- Kosten/Slippage berücksichtigen.
- Trade nur weitergeben, wenn Limits eingehalten werden.

8. Ausführung

Wo: Navigation: Start und täglicher Handel > Ausführung

Warum: Der Bereich ist der kontrollierte Übergang von einer begründeten Entscheidung zu einer später möglichen Order. Im aktuellen P0/P1-Kanal dient er ausschließlich der Shadow-/Paper- und Sicherheitsprüfung.

Wann: Nur nach vollständigem Risiko- und Freigabecheck.

Wie:

- Routing-/Betriebsmodus prüfen.
- Live-Execution und Order-Aktionen nicht freigeben.
- Trade-Plan im Shadow-/Paper-Pfad dokumentieren.
- IBKR erst nach P0/P1-Abnahme und gesonderter P2-Freigabe verwenden.

Grenze/Hinweis: ops/release.json sperrt im P0/P1-Kanal Live Execution, Order-Aktionen, Force-Learning, PRT-Promotion und Brokerrechtsänderungen.

9. Validierung und Datenqualität

Wo: Navigation: Analyse und Kontrolle > Validierung; Daten und Quellen > Datenqualität

Warum: Diese Bereiche beantworten, ob die Grundlage der Analyse belastbar ist.

Wann: Bei ungewöhnlichen Scores, fehlenden Charts, Widersprüchen oder vor Lernfreigaben.

Wie:

- Quote-/Bar-Frische und Mapping kontrollieren.
- Kanonische Charts/Bars separat vom Shadow-Pfad prüfen.
- Unplausible Outcomes und stale Daten fail-closed behandeln.
- P0 erst dann als bestanden behandeln, wenn TRADE_CANDIDATE/NO_TRADE aus einer belastbaren Datenlage abgeleitet werden kann.

10. Lernen

Wo: Navigation: Analyse und Kontrolle > Lernen

Warum: Lernen soll aus belastbaren Ergebnissen Muster ableiten. Schlechte Daten dürfen nicht in bessere Scores umetikettiert werden.

Wann: Erst nach plausibilisiertem Outcome und gesunder Datenlage.

Wie:

- Outcome-Verfügbarkeit prüfen.
- Plausibilitätsstatus lesen.
- Richtung, Trade-R und später reale Kosten getrennt bewerten.
- Lernfreigabe nur bei gesunden Gates zulassen.

11. Backtest

Wo: Navigation: Strategien und Dokumentation > Backtest

Warum: Backtest, Holdout und Walk-forward helfen in P1 zu prüfen, ob ein beobachteter Edge außerhalb des Trainingsfensters und unter realistischen Kostenannahmen trägt.

Wann: Bei Strategieänderungen oder zur Holdout-/Kalibrierungsprüfung.

Wie:

- Strategie und Zeitraum wählen.
- Datenqualität des Testzeitraums prüfen.
- Holdout/Walk-forward vom Trainingsfenster trennen.
- Kosten- und Slippage-Annahmen dokumentieren.
- Kalibrierung und Robustheit gegen Regimewechsel prüfen.

12. Journal / Transaktionsbuch

Wo: Navigation: Strategien und Dokumentation > Journal bzw. Transaktionsbuch

Warum: Hier bleibt nachvollziehbar, warum eine Entscheidung getroffen wurde und was daraus geworden ist.

Wann: Nach Analyse, Shadow-Trade oder realem Trade; außerdem für spätere Ursachenanalyse.

Wie:

- Entscheidungsgrund dokumentieren.
- Planwerte und tatsächliche Werte getrennt festhalten.
- Outcome ergänzen.
- Abweichungen und Lernpunkte markieren.

13. PRT-Bridge / Quellen / Routinen

Wo: Navigation: Daten und Quellen > Quellen / Import / Datenqualität / Routinen

Warum: Dieser Bereich verwaltet den Datenzufluss. Die PRT-Bridge R5 liefert aktuell reale Marktbeobachtungen in den Shadow-Pfad.

Wann: Bei Start, Störung, Mapping-Fehlern oder vor Promotion-Entscheidungen.

Wie:

- PRT Runtime und Bridge starten/prüfen.
- Gerätebindung prüfen.
- Beobachtungszahl, Mapping und Bid/Ask kontrollieren.
- Routinen/Imports auf Fehler prüfen.
- Erst bei stabiler Dauer die nächste Promotion-Stufe prüfen.

14. Steuerung / Policies / Einstellungen

Wo: Navigation: System und Governance > Steuerung / Policies / Einstellungen

Warum: Hier werden Regeln und technische Betriebsparameter verwaltet, nicht einzelne Trades.

Wann: Bei Systempflege, Freigaben oder Änderung von Schutzregeln.

Wie:

- Aktuellen Betriebsmodus prüfen.
- Policies vor Änderung dokumentieren.
- Fail-closed-Regeln nicht als Komfortoption behandeln.
- Änderungen anschließend mit Preflight/Negativtests prüfen.

15. Deployment Control Plane

Wo: Technischer Betriebsweg: privates GitHub-Repository > CI / Runtime Audit / Stage Candidate

Warum: Der Entwicklungspfad soll schneller werden, ohne einen allgemeinen SSH- oder Produktions-Schreibzugang zu öffnen. Audit und Staging bleiben deshalb technisch vom Production-Deploy getrennt.

Wann: Bei Diagnose, Vorprüfung und Vorbereitung einer neuen konsolidierten Version.

Wie:

- Bereinigten Repository-Stand und CI prüfen.
- Read-only Runtime Audit nur über den eingeschränkten Forced-Command-SSH-Pfad ausführen.
- Kandidaten inhaltsadressiert stagen und Hash/Manifest prüfen.
- Stage-Erfolg nicht mit Production-Deploy oder Handelsfreigabe gleichsetzen.

Grenze/Hinweis: Der aktuelle Gate-v2-Quellstand autorisiert keine Produktionsmutation.

4. Drei Kernaufgaben

P0: Von Marktdaten zu TRADE_CANDIDATE oder NO_TRADE

1. Betriebszentrale: Daten-/Providerstatus prüfen.
2. Quotes/Bars und Charts auf Frische/Konsistenz prüfen.
3. Frühchancen/Ranking als Kandidatenselektion lesen.
4. Prognose und Chart-Signale gegen die These prüfen.
5. Risiko-Gates anwenden.
6. Ergebnis ausdrücklich als TRADE_CANDIDATE oder NO_TRADE dokumentieren.

P1: Einen Trade-Kandidaten als Edge-Evidenz prüfen

1. Trade-Plan mit Einstieg, Stop, Ziel, Größe und Kostenannahmen dokumentieren.
2. Shadow-/Paper-Ausführung erfassen.
3. Outcome nur bei plausibler Datenlage schließen.
4. Richtung und Trade-R getrennt bewerten.
5. Slippage/Kosten und Realisierbarkeit berücksichtigen.
6. Holdout/Walk-forward und Kalibrierung prüfen.

Eine neue Version sicher vorbereiten

1. Repository-/CI-Status prüfen.
2. Read-only Runtime Audit ausführen.
3. Release-Kandidat stagen und Hash/Manifest verifizieren.
4. Keine Produktionsmutation aus Audit/Stage ableiten.
5. Konsolidierten Release erst nach eigener Freigabe und Rollback-/Regressionstest produktiv setzen.

5. Typische Fehlinterpretationen

Problem	Rangliste oder Signal ist vorhanden, aber Bars/Charts sind nicht frisch
Ursache	Teilpfade können unterschiedliche Zustände haben; vorhandene Scores ersetzen keine gesunde Datenbasis.
Vorgehen	P0 fail-closed behandeln und NO_TRADE bzw. nicht entscheidungsfähig setzen, bis der kanonische Datenpfad gesund ist.

Problem	Audit oder Stage Candidate ist erfolgreich
Ursache	Diese Aktionen prüfen bzw. bereiten vor, sie ersetzen die Produktionsanwendung nicht.
Vorgehen	Nicht als Deployment- oder Handelsfreigabe interpretieren; separaten Release-/Rollback-/Regressionstestpfad einhalten.

Problem	IBKR ist noch nicht für Live-Ausführung freigegeben
Ursache	IBKR gehört zur P2-Stufe nach nachgewiesener P0/P1-Reife.
Vorgehen	Shadow-/Paper-Evidenz weiter aufbauen; Brokerrechte nicht vorzeitig öffnen.

6. Release- und Sicherheitsgrenze

Der private GitHub- und SSH-Pfad dient Diagnose, Audit und Staging. Der aktuelle P0/P1-Releasekanal sperrt Live Execution, Order-Aktionen, erzwungenes Lernen, PRT-Promotion und Änderungen an Brokerrechten. Ein erfolgreicher Audit oder Stage Candidate ist daher nur Evidenz für einen vorbereiteten technischen Stand, nicht für eine Produktiv- oder Handelsfreigabe.