

Contents

DOMAIN_RULES_EXITON_TRADING_v0.1.md	1
EXITON 自動投資システム – ドメインルール v0.1	
1. システムの目的・スコープ	2
DR-TR-001 システムの目的	2
DR-TR-002 自動発注は行わない	2
DR-TR-003 対象ユーザー	2
DR-TR-004 将来の商用化	2
2. データに関するルール（時系列・OHLCV）	2
DR-TR-010 ルックアヘッド禁止	2
DR-TR-011 時刻・タイムゾーン	2
DR-TR-012 データ欠損・異常値	2
3. 売買ロジック・リスク管理ルール	2
DR-TR-020 売買単位	2
DR-TR-021 手数料・スリッページ	3
DR-TR-022 レバレッジ	3
DR-TR-023 Rベースのポジションサイジング	3
4. 安全装置（Fail-safe / 金融安全）	3
DR-TR-060 最大ポジションサイズ（Max Position Size）	3
DR-TR-061 口座全体リスク（Max Portfolio Risk）	3
DR-TR-062 キルスイッチ（Drawdown Kill Switch）	3
DR-TR-063 過大ポジションの禁止	4
5. 戦略・シグナルの定義	4
DR-TR-030 戦略IDとバージョン	4
DR-TR-031 シグナルの意味の統一	4
DR-TR-032 シグナル生成のタイミング	4
6. 利用者への説明・リスク表示	4
DR-TR-040 投資助言ではない旨の明示	4
DR-TR-041 過去成績と将来成績	4
7. 変更管理	4
DR-TR-050 本ドキュメントの変更手順	4
DR-TR-051 バージョン管理	5

DOMAIN_RULES_EXITON_TRADING_v0.1.md

EXITON 自動投資システム – ドメインルール v0.1

本ドキュメントは、EXITON 自動投資システム（コード名：ai-signal-chart / EXITON Trading Simulator、以下「本システム」）における**業務ルール・投資ロジック上の前提・安全装置**を定義する。

このルールは：

- バックエンド実装（特に backend/core / backend/strategies）
- テスト設計・レビュー
- 将來の商用化検討

において**必ず守られるべき制約条件**である。

ルールID形式：DR-TR-XXX。

1. システムの目的・スコープ

DR-TR-001 システムの目的

- 本システムは、株式・ETF等の市場データを用いて：
 - 売買戦略のバックテスト
 - パラメータ最適化
 - 売買シグナルの可視化を行う **学習・検証用ツール** である。
- 利用者に対して「どの戦略がどの程度機能したか」を可視化し、自らの投資判断をサポートすることを目的とする。

DR-TR-002 自動発注は行わない

- 本システムは、**証券会社への自動発注機能を持たない**。
- 本システムが出力する内容はあくまで「シグナル・バックテスト結果」であり、実際の売買執行は利用者が自ら使用する。

DR-TR-003 対象ユーザー

- 個人投資家・個人開発者・開発者兼トレーダーを主な対象とする。
- 金融機関向けのシステムを直接代替することは想定していない。

DR-TR-004 将来の商用化

- 将来的に SaaS として有料提供する可能性を考慮し、本ドキュメントのルールは**商用化前提の安全性・説明責任**を意識して設計する。
-

2. データに関するルール（時系列・OHLCV）

DR-TR-010 ルックアヘッド禁止

- いかなるバックテスト・シミュレーションにおいても、**その時点で利用できなかった未来のデータを参照してはならない**。
- 特に以下は禁止：
 - 当日終値でシグナルを生成し、同じ終値で約定させる
 - 翌日のギャップ（ギャップアップ/ダウン）を当日の判断材料に使う
- 実装では「利用可能なインデックス範囲」を明示し、テストでルックアヘッドがないことを検証する。

DR-TR-011 時刻・タイムゾーン

- 内部保存は原則として **UTC** を用いる。
- 表示の際はユーザー設定に応じたタイムゾーン（デフォルト：JST）で表示する。
- 日足データの1本のバーは、データプロバイダの定義に従い、その解釈（どの時間帯を含むか）を揃える。

DR-TR-012 データ欠損・異常値

- 欠損・明らかなスパイク等が検出された場合：
 - デフォルト動作は「警告を出して当該期間のバックテストをスキップ」または「処理を中断」。
 - 補間（前日値保持・線形補間等）を行う場合：
 - 採用した補間手法を明記し、バックテスト結果の解釈に影響することを示す。
-

3. 売買ロジック・リスク管理ルール

DR-TR-020 売買単位

- 株式のバックテストにおいて、売買数量は常に **売買単位（単位株）** に丸める。

- ・デフォルト丸め規則：
 - `floor()` (切り捨て)
- ・丸め方法を変更する場合はドキュメントとテストで明示する。

DR-TR-021 手数料・スリッページ

- ・バックテストでは、**必ず手数料またはスリッページモデルを適用する。**
- ・少なくとも以下のいずれかをサポートする：
 - 固定額手数料 (例：1トレードあたり¥100)
 - 約定代金に比例する手数料 (例：0.1%)
 - スリッページ (例：約定価格に ±X% の誤差)
- ・UI で選択可能にする場合、結果への影響が分かる形で表示する。

DR-TR-022 レバレッジ

- ・本システムのデフォルト設定では **レバレッジ1倍 (現物のみ)** を前提とする。
- ・信用取引・レバレッジを導入する場合：
 - 証拠金管理・強制ロスカット等のルールを別途定義し、
 - 新しいドメインルール ID として追加する。

DR-TR-023 Rベースのポジションサイジング

- ・ポジションサイズは原則として **1R (口座資金に対する許容損失量)** 概念に基づいて計算する。
 - ・ユーザーは：
 - 1R を金額 (¥) または [%] で指定する。
 - ストップ位置に応じて株数が決まる。
 - ・詳細な式は `RISK_MANAGEMENT_SPEC.md` にて定義する。
-

4. 安全装置 (Fail-safe / 金融安全)

DR-TR-060 最大ポジションサイズ (Max Position Size)

- ・本システムが計算・提案する1トレードのリスクは、**口座資金の `max_risk_per_trade` を超えてはならない。**
- ・デフォルト値の例：
 - `max_risk_per_trade = 0.02` (口座の2%)
- ・この制限は：
 - バックテスト
 - リアルタイムシグナル提案 の双方に適用する。

DR-TR-061 口座全体リスク (Max Portfolio Risk)

- ・同時保有している全ポジションの合計リスクは、**口座資金の `max_portfolio_risk` を超えてはならない。**
- ・例：`max_portfolio_risk = 0.10` (10%)

DR-TR-062 キルスイッチ (Drawdown Kill Switch)

- ・累積ドローダウン (ピークからの下落率) が `kill_switch_drawdown` を超えた場合：
 - すべてのポジションをクローズしたものとみなし、
 - 以後のバックテストシグナル生成を停止する。
- ・リアルタイム運用に拡張する場合も、同様のキルスイッチ発想を適用する。

DR-TR-063 過大ポジションの禁止

- もし戦略ロジックが誤って異常なサイズ（例：口座の100%超）を返した場合：
 - システムは強制的に取引をキャンセルし、
 - ログに警告を記録する（silent failure 禁止）。
-

5. 戦略・シグナルの定義

DR-TR-030 戦略IDとバージョン

- 各戦略には STR_< >_< > のIDを付与する：
 - 例：STR_MA_001, STR_RSI_001
- ロジックの構造変更時はバージョン番号を更新する：
 - 例：STR_MA_001 v1.1
- バックテスト結果および保存戦略プリセットには、
 - 戦略ID + バージョンを必ず紐づける。

DR-TR-031 シグナルの意味の統一

- シグナルの標準定義：
 - BUY：ロングポジションを新規に建てる、またはショートをクローズしてロングに転換
 - SELL：ロングポジションをクローズする（現物のみの場合）
 - HOLD：新規アクションなし
- 戦略固有のシグナル（例：REDUCE, ADD）を追加する場合は、
 - STRATEGY_DOC_<ID>.md に意味と挙動を明記する。

DR-TR-032 シグナル生成のタイミング

- 日足戦略の場合：
 - 当日終値確定後にシグナルを決定し、
 - 翌営業日寄り付きでの約定を前提とする。
 - 足種・タイミングが異なる戦略では、
 - どのバーのどのタイミングのデータを使うかをドキュメントに明示する。
-

6. 利用者への説明・リスク表示

DR-TR-040 投資助言ではない旨の明示

- 本システムは投資一任・投資助言サービスではない。
- UI 上に、目立つ形で以下を表示する：
 - 「本ツールは投資判断の参考情報を提供するものであり、実際の投資判断・売買は利用者自身の責任で行ってください。」

DR-TR-041 過去成績と将来成績

- バックテスト結果を表示する画面には、「過去の運用成績は将来の成績を保証するものではありません。」の注意書きを常に添える。
-

7. 変更管理

DR-TR-050 本ドキュメントの変更手順

- 本ドキュメントを変更する際は：

1. GitHub Pull Request として変更案を提出
2. 変更理由・影響範囲を SPEC_HISTORY.md に記録
3. PM（こうすけ）または指定されたレビューAIの承認後にマージ

DR-TR-051 バージョン管理

- 重大なルール変更（例：レバレッジ解禁、キルスイッチ無効化）は、
 - ドキュメントバージョンを v0.1 → v0.2 のように更新する。
- 古いバージョンで実行したバックテスト結果は、
 - その時点のルールバージョンとともに保存・表示することが望ましい。

以上。