

売買システムの利用状況等に係る報告制度の導入について

平成 19 年 3 月 27 日
株式会社 東京証券取引所

趣旨

昨今の情報技術の飛躍的な発展による証券投資に係るインフラへのアクセスの大幅な向上に伴い、自動発注システムを利用したプログラム売買やインターネットを經由した注文の受託等、証券取引を取り巻く環境は大きく変化しており、注文件数の急激な増加やそれに伴う当取引所システム負荷の上昇をもたらしています。

当取引所では、市場機能を継続的に提供することは証券取引所の最重要課題の一つであるとの認識のもと、これまでに数次にわたりシステムの能力増強を行う等、これらの環境変化の下でも安定的に稼動するシステムの構築・運用に努めてまいりました。

こうした中、取引参加者におけるシステム利用の状況についても、これまで可能な限りきめ細かく情報を取得するよう努めてまいりましたが、取引参加者側のシステム能力増強の頻度が上がり増強のための期間も短縮される中、当取引所において適切なシステム能力増強を行うための体系だった把握が困難となっております。

そこで、当取引所における将来的なシステムの処理能力の見積もり精度を向上させ、システムの安定稼働に資するために、取引参加者の今後の予定を含めた売買システムの利用状況等の把握を行うための枠組みを構築し、取引参加者は取引所への報告等のシステム運営への協力を行うこととします。

概要

| 項目 | 内容 | 備考 |
|-----------------------|--|---|
| 取引参加者のシステム利用状況等に係る報告等 | <p>1. 取引参加者は、当取引所の売買システムの安定的な稼働に協力するものとし、当取引所が定めるところにより、原則として、以下の項目について報告することとします。</p> <p>(1) システムの利用状況及び今後の見通し 注文発注件数の内訳（発注件数全体に占める、取引参加者に設置された自動発注システムによる注文、取引参加者の担当者を介さずに発注される注文¹、インターネット口座からの注文²の割合） 該当期間における注文発注件数の増減に関する傾向 次期（6か月）における注文発注件数の増減に関する見通し 想定される変動要因</p> <p>(2) システムの能力及び増強予定 当取引所への注文発注可能件数（現在） 今後1年間の当取引所への発注可能件数に影響を与えるシステム変更の予定</p> <p>(3) その他 システムの利用状況に影響があると思われる事項</p> <p>2. 取引参加者は、上記の報告内容に関する当取引所からのヒアリング等に協力することとします。</p> | <ul style="list-style-type: none"> ・ 半年に一度(4月・10月)、システムの利用状況や能力変更の予定等について報告を行うこととします。 1 機関投資家等のいわゆるDMAによる発注を想定（インターネット口座からの注文は除く。） 2 個人投資家等の発注を想定 ・ 報告により入手した情報は、当取引所のシステム運営に関する業務にのみ用い、個別の取引参加者に係る情報について、外部提供を行いません。 ・ 先物・オプション取引についても、市場の実情に合わせて、同様の報告を行うこととします。 |

実施時期（予定）

平成19年秋を目途に実施します。

以上