

1. 東証におけるシステム障害について

- 10月9日に、東京証券取引所において、システム障害が発生し、一部の証券会社において株式の発注等ができない状況となった。
- 今回の件を踏まえ、各証券会社においては、同様の障害の発生を想定して、対応を検討してもらいたい。例えば、
 - ・ 自社が使用しているシステムで他の振分装置に切替できなかった理由等を解明し、適切な改善措置を講じていただきたい。システム会社が提供するシステムを使用している証券会社にあっても、ベンダー任せにせず、自社のシステムの仕様を確認するよう心がけてほしい。
 - ・ このほか、顧客対応に時間を要した先もみられた。顧客と連絡が取れず約定処理が進まなかった面があることは承知しているが、積極的に顧客に連絡を取り、速やかに終了できるようお願いしたい。
 - ・ 今回の障害を受けて、東証においては取引システムに係る接続条件書の文言の明確化や、システム障害に係るテストを行うこととしているため、証券会社においても当該テストに参加するなど、東証が講じる再発防止策を踏まえ、適切な対応を行っていただきたい。
 - ・ 加えて、HFT業者の受託証券会社においては、東証に発注をする立場から、取引システムの管理を十分に行うための措置を講じているかどうか等を確認してもらいたい。また、東証は受託証券会社やHFT業者に対して、システム面・注文執行面での確認項目の取りまとめやその点検等を実施する予定であることから、受託証券会社においても適切に対応いただきたい。
- 本件に限らず、システム上の問題が生じた場合に、速やかに問題解決を図り、適切な顧客対応ができるよう普段から様々な想定のもと、準備を行っていただきたい。

2. 相場急変時の対応について

- 先般の意見交換会でも言及させていただいたが、8月はトルコリラ

が急落し、トルコリラ関連の普通債、仕組債のほか、これらを組み入れた投資信託が大幅に値下がりました。また、10月に米国株式市場が大きく下落して以降、その影響を受けて日本の株式市場も大きく下落するなど、このところ相場の変動が大きくなってきている。

- このように相場が急変する際には
 - ・ 各証券会社におけるリスク管理を適切に行う
 - ・ 相場の急変に伴い、仮に顧客に大きな損失が生じた場合には、顧客に資産の状況等について速やかな説明を行い、顧客に対して適切なフォローアップを行う
 - ・ 本部の管理部門と営業店の適切な連携の下、勧誘時の情報提供が十分であったのかといった点についても改めて確認を行い、問題が生じていれば適切に是正する
- など、証券会社自身のリスク管理及び顧客のフォローアップの双方について適切な対応をしてもらいたい。

3. 改元及び10連休に向けた対応について

- 来年5月1日に予定されている皇太子殿下の御即位に際しては、御即位の日を来年限りの祝日とし、祝日前後の4月30日と5月2日も休日の扱いとして、10連休とする方針が本年10月、総理より示された。
- 関連法案について国会に提出されたところであるが、仮に10連休となった場合には、各社において、例えば、連休前後に増加する取引の処理や連休中に蓄積した取引データの処理にかかるシステムの保存容量や処理能力の確認などが必要になると考えている。
- 各証券会社におかれては、必要な要対応事項の洗い出しを徹底した上で、準備に万全を期していただくようお願いする。

(以上)