

業務の内容及び方法を記載した書類の記載要領

- ※ 金融商品取引法第66条の51第2項第2号に定める書類の参考にしてください。
- ※ この要領に記載している点だけでなく、高速取引行為者ごとの個別の事情に応じて、業務の内容及び方法に関する事項が的確に記載されていることが必要です。
- ※ 業務の内容又は方法について変更があったときは、届出が必要ですので、内容を別紙により記載した場合であっても変更があったときは、届出が必要です。

1. 業務運営に関する基本原則

- ・ 高速取引行為に係る業務の運営にあたっての基本的な考え方等を記載。
(記載例) 当社は、高速取引行為に係る業務を遂行するにあたり、社内規則のほか、金融商品取引法及び関係法令等を遵守するとともに、これに必要な社内体制を整備するものとする。

2. 業務執行の方法【監督指針 III-2-1-1、2、3 参照】

- ・ 下記3. と一体的に記載してもよい。
- ・ 高速取引行為に係る業務の執行体制（部門の名称、所掌業務、部門内の指揮・命令系統等）を記載。
なお、高速取引行為を行う各部門（業務）については、例えば、以下の部門が考えられます。

- 高速取引行為を行うことについての判断を行う部門
- プログラムを作成する部門
- 電子情報処理組織その他の設備の管理をする部門
 - ・ 取引システムの日常的な運用だけでなく、保守も含む。
 - ・ 異常動作等防止の管理を含む。
- コンプライアンス部門
- 帳簿書類、報告書等を作成及び管理する部門
- リスク管理部門
- 売買管理部門
 - ・ 不公正取引等防止の管理（法人関係情報の管理、売買審査基準の策定等）を含む。
- 内部監査部門

- ※ 体制整備については、各高速取引行為者の業務の内容・特性・規模・複雑性等に応じてなされる必要があると考えられます。また、高速取引行為に係る業務を

適確に遂行できるのであれば、必ずしも、高速取引行為者本体において上記の部門全てを独立して設置することを求められているものではありません。

- ・ 一部の業務を委託する場合は、委託先の名称及び委託先の管理方法について記載。
- ・ 高速取引行為に係る業務を適確に遂行するための社内規則等の整備状況を記載。
- ・ 社内規則等遵守のための研修等の措置の内容を記載。

3. 業務分掌の方法

- ・ 部署（組織体制）、責任者（部長、課長などの役職名）の業務分担、役割などを記載。
- ・ 上記2. において、一体的に記載してもよい。

4. 取引戦略ごとに、当該取引戦略の概要（次に掲げる事項を含む。）【監督指針 III-3-1-1 参照】

- ・ 記載にあたっては、以下の事項を含み、高速取引行為者が採用する全ての取引戦略について、基本的な仕組みを具体的かつ分かりやすく記載。
 - イ. 取引戦略の種類
 - ロ. 高速取引行為に係る金融商品取引所等の名称又は商号
 - ハ. 高速取引行為の対象とする有価証券又は市場デリバティブ取引の種類
- ・ 別紙により記載してもよい。

（記載例1）

取引戦略の名称：●●●●

取引戦略の概要：当該取引戦略の特徴を簡潔に記載

取引戦略の種類：マーケットメイク戦略

金融商品取引所等：東京証券取引所

対象とする有価証券又は市場デリバティブ取引：日本株式

利用する金融商品取引業者等：▲▲証券、■●証券、・・・

（記載例2）

取引戦略の名称：●●●●

取引戦略の概要：当該取引戦略の特徴を簡潔に記載

取引戦略の種類：アービトラージ戦略

金融商品取引所等：東京証券取引所、大阪取引所

対象とする有価証券又は市場デリバティブ取引：日本株式、日経225先物

利用する金融商品取引業者等：▲▲証券、■●証券、・・・

※ 平成30年4月1日時点で高速取引行為を行っている申請者は、申請時点で行ってい

る取引を記載し、平成 30 年 4 月 2 日以降に新たに高速取引行為を開始する申請者は、登録後に開始する予定の取引を記載。

5. 高速取引行為に係る業務に関し、法令等を遵守させるための指導に関する業務を統括する者の氏名及び役職名

- ・ 下記 6. とともに別紙により一体的に記載してもよい。

6. 高速取引行為に係る業務を管理する責任者の氏名及び役職名

- ・ 以下の業務を管理する責任者を含むものとする。
 - 高速取引行為を行うことについての判断
 - 高速取引行為に係るプログラムの作成
 - 電子情報処理組織その他の設備の管理

7. 高速取引行為に係る電子情報処理組織その他の設備の概要、設置場所及び保守の方法

- ・ 別紙により、システム構成を記載した概要図を添付してもよいが、少なくとも、以下の事項を記載する。

イ. 設備の概要

- ・ レイテンシーを短縮するための、取引システムの概要を分かりやすく記載。
- ・ 仮想サーバ等の専有状況について、契約証券会社等、専有数を記載。

ロ. 設置場所

- ・ (記載例) 日本取引所グループが提供するコロケーションエリア

ハ. 保守の方法

- ・ 上記 2. において記載していれば、本項での記載は不要。

8. 高速取引行為に係る電子情報処理組織その他の設備の管理を十分に行うための措置の内容【監督指針 III-2-1-2、3 参照】

- ・ 異常動作等により金融商品取引市場の機能の十全な発揮に支障を及ぼさないようにするための仕組み（例えば、リミットの設定、キルスイッチの設定、負荷テストの実施）の概要を記載。
- ・ 上記の仕組みを適切に運用するための管理の概要について、上記 2. において記載していれば、本項での記載は不要。

以 上