

(投資家・マーケットメイカーからの) 注文を受託する証券会社向け CONNEQTOR 導入のポイント

本資料は証券会社が CONNEQTOR の導入をご検討いただく際のポイントをまとめたものです。

1. 接続方法・自己委託の別のご検討・決定

(接続方法)

証券会社には FIX 接続方式¹と GUI 利用方式²との 2 通りをご用意しており、どちらか一方をご選択いただけます³。接続方法によって異なる申込書が異なりますので、3-1.または 3-2.をご参照いただき、お選びいただいた接続方法向けの申込書をご提出ください。

	概要	システム開発	オペレーション
FIX 方式	<ul style="list-style-type: none"> ・CONNEQTOR からの発注を FIX 電文で受信する方式 ・システム開発は必要だが、自動で ToSTNeT への発注まで行うことが出来る 	あり	不要 (ToSTNeT 発注を自動化する前提)
GUI 方式	<ul style="list-style-type: none"> ・CONNEQTOR からの発注を端末で確認する方式 ・システム開発は不要だが、手動で ToSTNeT に発注する必要 	なし	毎回必要

(自己委託の別)

委託部門と自己部門の両方をご利用いただく場合には、一般的に、それぞれの情報が見えないようにする、あるいは発注経路を分ける必要があります。そのため、同一の証券会社でも、委託と自己を明記してお申込みいただくこととなります。委託と自己を明記していただくことで、CONNEQTOR 上では自己・委託はそれぞれ 2 つの異なる組織として登録され、異なる証券会社のように扱われます。これにより、お互いの発注情報等を参照できなくすることが可能です。

¹ CONNEQTOR 上で顧客の取引条件が合致した後に、顧客からの発注依頼を FIX で受信し、証券会社システムから発注する方式です。

² CONNEQTOR 上で顧客の取引条件が合致した後に、顧客からの発注依頼を GUI で受信し、証券会社システムからマニュアルで発注する方式です。

³ 直接発注方式 (CONNEQTOR 上で顧客の取引条件が合致した後に、CONNEQTOR 上に設置した仮想サーバから直接 ToSTNeT へ発注する方式) のご利用も可能ですが、ご利用を希望される場合には、個別にご相談ください。

自己委託の別については、証券会社としての申請に必要な各申込書に明示いただく箇所がありますので、申込書のフォーマットに沿ってご記載ください。

また、関連会社の自己勘定の場合は、「自己」としてお申込みください。ToSTNeT への発注時に付する自己委託区分については「委託」を設定することになり、東証側で別途設定を行う必要があるため、事前にお知らせいただきますようお願いいたします。

なお、「代理投資家機能」という、証券会社が投資家から電話で依頼を受け、投資家の代理で CONNEQTOR を利用する機能もあります。代理投資家機能については、「CONNEQTOR の概要 (代理投資家機能)」をご参照ください。

2. CONNEQTOR 接続証券会社としての公表

証券会社として CONNEQTOR 経由で注文を受託することを決定いただいた場合、注文受託開始予定日・公表のタイミングについて東証までお知らせください。東証ウェブサイト等で「CONNEQTOR 経由での受注を行っている証券会社様」として、証券会社名をお客様にご紹介させていただきます。先にテストを実施いただいてからの公表でも構いません。

3-1. FIX 接続の場合の準備

(GUI 接続の場合には 3-2 をご覧ください)

FIX 接続仕様書に従い、接続をご準備いただきます。流れは以下のとおりです。接続にあたってテストを実施いただく必要があります。実施日程は東証との調整になります。ご希望の日程でテストが実施できない場合もございますので、お早目のご準備をお願いいたします。

(1) テスト環境での確認

① 接続情報の授受

- 登録申込書「BT-51F_ FIX 接続登録申込書」をご提出ください。CONNEQTOR テスト環境と接続する際の証券会社 IP アドレスとポート番号をお知らせください。東証側の IP アドレス等をお伝えし、最新版のマニュアル「CONNEQTOR 操作マニュアル（証券会社向け-GUI・FIX）」とチェックリスト「（参考）証券会社向け確認チェックリスト（FIX 編）」をお送りします。

② 疎通確認

- 設定情報をもとにテスト環境においてネットワークレベルの疎通確認を行ってください。

③ 業務電文確認

- CONNEQTOR 上で RFQ と気配提示をマッチングさせ、それにより生じる注文・約定系の FIX 電文の授受を確認します。具体的には、以下のやり取りが正しくできることをご確認いただきます。
 - A) CONNEQTOR との FIX セッションの確立とハートビートによるセッション維持
 - B) 接続仕様書接続編 6.2 アプリケーションメッセージシーケンスに記載されている各メッセージフロー及び同データフォーマット編に記載されている各種メッセージ、各最低 1 回の授受。
- 上記の確認のために、証券会社に投資家・マーケットメイカーのテスト ID を払い出しますので、それぞれの状況を作り、送信される電文をご確認ください。
- 提供されている機能を一通り確認する場合には、上記のチェックリストをご利用ください。
- (FIX 電文を受けたのちに) 証券会社から ToSTNeT に発注する部分のテストについては、必ずしも CONNEQTOR のテストと同時に実施していただく必要はありません。

(2) 本番環境での確認⁴

- ① 接続情報の授受
 - CONNEQTOR 本番環境と接続する際の証券会社 IP アドレスとポート番号をお知らせください。東証側の IP アドレス等をお伝えします。
- ② 疎通確認
 - 設定情報をもとにネットワークレベルの疎通確認を行います。
- ③ 業務電文確認（FIX セッション確立まで）
 - CONNEQTOR との FIX セッションの確立とハートビートによるセッション維持の確認をお願いします。
 - 注文・約定電文等の FIX 電文の授受については、すでにテスト環境で確認できているとして、本番環境での確認は省略することができます。

⁴ 平日か休日かは問いません。また、ToSTNeT への接続も必須ではございません。

3-2. GUI 接続の場合の準備

GUI 接続でご利用いただく場合には、GUI の操作及び証券会社のオペレーションを確認いただきます。

(1) テスト環境での確認

① ID の申請

登録申込書「BT-51G_GUI テストユーザー登録申込書」をご提出ください。東証から ID/パスワードを発行⁵し、最新版のマニュアル「CONNEQTOR 操作マニュアル（証券会社向け-GUI・FIX）」とチェックリスト「（参考）証券会社向け確認チェックリスト（GUI 編）」をお送りします。

② GUI でのオペレーション確認

以下の各項目について、実際にオペレーションを担う担当者様が問題なくオペレーションが行えることをご確認ください。提供されている機能を一通り確認する場合には、上記のチェックリストをご利用ください。

- 顧客からの注文の確認
- 確認した注文の、ToSTNeT への発注⁶
- ToSTNeT で正常に約定した場合の、CONNEQTOR への約定結果の反映
- ToSTNeT で約定しなかった場合の、CONNEQTOR への約定結果の反映
- 顧客からの注文の受託拒否

(2) 本番環境での確認

本番環境とテスト環境の画面は同一です。テスト環境でオペレーションを確認いただければ、本番環境での別途のご確認は不要です。

⁵ 東証は証券会社に「TB-51-1_GUI テストユーザー登録完了のお知らせ（代表者向け）」と「TB-51-2_GUI テストユーザー登録完了のお知らせ」をお送りします。TB-51-1 には、お申込みいただいた証券会社の全アカウントのリストが記載されており、TB-51-2 には各アカウントのパスワード等詳細な情報が記載されています。」

⁶ 実際に発注いただく必要までではございませんが、発注オペレーションができることのご確認をお願いします。

4. 本番利用申込み

上記の 3-1 または 3-2 の準備が完了次第、東証に本番利用申込み「BT-52_本番利用申込書」をご提出ください。（投資家・代理投資家が気配提示を依頼する際に選択可能な決済日は、原則として T+2~5 となります。本番環境において、投資家・代理投資家が RFQ 送信時に選択可能な決済日を T+2 のみに制限することを希望する場合は、申込書の所定の箇所にチェックを入れてご提出ください。）

手続きが完了し次第、登録完了のお知らせ「TB-52-1_本番利用申込み完了のお知らせ」をお送りします。GUI をご利用の場合には、本番ユーザー登録完了のお知らせ「TB-52-2_GUI 本番ユーザー登録完了のお知らせ（代表者向け）」及び「TB-52-3_GUI 本番ユーザー登録完了のお知らせ」をお送りします。どのユーザーが本番環境に登録されたのかをご確認ください。

これらの手続きが完了することで、本番環境でお客様からの受注を行うことが出来る状態となります。

5. 投資家/マーケットメイカーからの利用登録依頼への対応

上記の準備と並行して、お客様（投資家/マーケットメイカー）より、利用にあたっての事前確認の依頼があります。お客様は利用を希望する証券会社へ事前に確認した上で、東証に利用証券会社申込書を提出しますので、証券会社様は当該お客様による CONNEQTOR 利用の可否や口座の有無をご確認の上、お客様にご回答ください。

なお、証券会社が CONNEQTOR の利用を開始しても、お客様（投資家/マーケットメイカー）による証券会社の下記利用登録（証券会社による確認が必要です）が完了しない限り、当該お客様のプルダウンには証券会社名は表示されず、選択出来ません。ですので、予期しないお客様からの注文が証券会社宛に発注されることはありません。

（1）口座 ID 付番・連絡先窓口の検討

- CONNEQTOR では、証券会社に、投資家・マーケットメイカーが使う「口座 ID」を振っていただきます⁷。
- 「口座 ID」は、CONNEQTOR 経由の注文内容を証券会社側で識別するための ID で、GUI への表示または FIX 電文によって通知されます。実際の口座番号を設定いただく必要はありませんが、証券会社内で一意となる ID⁸を設定してください。

⁷ マーケットメイカーの場合は、「口座 ID」に加え、「組織 ID」を任意に設定することが可能です。「組織 ID」については、特に指定がない場合、弊社側で付番します。

⁸ 付番にあたっては、半角英数字記号 60 文字以内でご設定ください。記号については「,（カンマ）」を除く通常記号の利用が可能です。ASCII コード値以外の特殊記号や制御文字は、ご利用いただけませんので、ご注意ください。

- 投資家・マーケットメイカーが利用登録を行う際に、証券会社の連絡先窓口を弊社にご提出いただく必要があります。投資家・マーケットメイカーから照会があった際に、回答する連絡窓口をご確認ください。

<口座 ID の使われ方>

- ① 例えば、A 証券が B 銀行のプロパー口座に対して「口座 ID = 12345」、特金口座に「口座 ID = 12367」を付番します。
- ② B 銀行は CONNEQTOR で利用証券会社を選ぶ際に、「A 証券プロパー口座」「A 証券特金口座」を選択可能になります。
- ③ B 銀行が「A 証券特金口座」を選択して取引を行った場合、A 証券では取引内容（銘柄や価格等）に加えて、「B 銀行」「口座 ID = 12367」からの発注であることを GUI もしくは FIX で確認出来ます。
- ④ A 証券は上記の情報を使って社内システムに登録・ToSTNeT に発注します。

(2) 投資家側の利用登録

- 証券会社には、投資家から利用証券会社登録申込書「IT-02-2_利用証券会社登録申込書（別紙）」が送付されますので、利用をフォーマットに沿って、口座 ID や担当者の連絡先をご記載の上、投資家へご返送ください。
- その後、投資家が東証へ利用証券会社登録申込書「IT-02-1_利用証券会社登録申込書」及び「IT-02-2_利用証券会社登録申込書（別紙）」を提出します。
- 投資家から東証に対して証券会社登録申込書が提出され次第、東証から証券会社へ内容の確認とデモ環境において注文受託の準備を依頼する書面「TB-01_利用申込みの確認依頼（デモ環境）」⁹を送付します。準備ができ次第、「証券会社の確認項目」に記入・チェックの上、ご返送ください。
- 投資家は本番で取引する準備が出来次第、東証に本番利用申請「IT-03_本番利用登録申込書」を東証に送付します。東証から証券会社宛に内容の確認と本番環境において注文受託の準備を依頼する書面「TB-02_利用申込みの確認依頼（本番環境）」¹⁰を送付します。準備ができ次第、「証券会社の確認項目」に記入・チェックの上、ご返送ください。東証の確認・登録が完了し次第¹¹、投資家は本番で売買を行うことが出来るようになります。

(3) マーケットメイカー側の利用登録

⁹ 情報を削除する場合には「TB-03_登録情報の削除依頼（デモ環境）」をお送りします。

¹⁰ 情報を削除する場合には「TB-04_登録情報の削除依頼（本番環境）」をお送りします。

¹¹ 東証は投資家に「TI-03_本番利用申込完了のお知らせ」を送付します。

- まず、マーケットメイカーは東証へ申込書「MT-31_ユーザー登録申込書」を提出します。MT-31には証券会社の連絡先を記入する欄がありますので、証券会社にはマーケットメイカーから、CONNEQTORの利用意向と、証券会社の担当者について照会がありますので、ご回答をお願いいたします。
- 東証がMT-31を確認し次第、証券会社には、マーケットメイカーの申込内容確認と注文受託の準備を依頼する書面「TB-31F_利用申込みの確認依頼（デモ環境・forFIX）」¹²をお送りしますので、準備ができ次第、記入・チェックの上、ご返送ください。
- 東証では、証券会社からTB-31の返信を受領次第、テスト環境において、マーケットメイカーが証券会社を指定して取引テストができるように設定いたします¹³。
- マーケットメイカーは本番で取引する準備が出来次第、東証へ「MT-32_CONNEQTOR本番利用申込書」の送付し、本番利用申込みを行います。東証から証券会社宛に内容の確認と本番環境において注文受託の準備を依頼する書面「TB-32F_利用申込みの確認依頼（本番環境・forFIX）」を送付します。準備ができ次第、「証券会社の確認項目」に記入・チェックの上、ご返送ください。東証の確認・登録が完了し次第¹⁴、マーケットメイカーは本番での取引を開始することができます。

以上

お問合せ

東京証券取引所 株式部 CONNEQTOR 係

電話番号： 03-3666-0141（代表）

メール： ask-conneqtor@jpx.co.jp

¹² CONNEQTORが直接発注する場合とFIXの場合で申請書が異なります。

¹³ お客様からの利用証券会社登録申込書を東証が受領次第、証券会社にご連絡をいたします。その時点で証券会社側の準備が整っていない等の理由でお客様情報の設定をご希望されない場合は、お知らせください。準備完了のご連絡をいただくまで、設定を延期します。

¹⁴ マーケットメイカーには「TM-32_本番利用申込完了通知」を送付します。