

高速取引行為を行う者の登録制等の導入に伴う業務規程等の一部改正について

2018年3月2日
株式会社大阪取引所

I. 趣旨

当社は、業務規程等の一部改正を行い、本年4月1日から施行します（詳細については、規則改正新旧対照表を御覧ください。）。

今回の改正は、本年4月1日に改正金融商品取引法が施行され高速取引行為を行う者の登録制等が導入されることに伴い、所要の対応を行うことによるものです。

II. 改正概要

1. 高速取引行為に係る取引戦略の区分の明示

- 取引参加者が高速取引行為に係る呼値を行う場合には、その旨を、高速取引行為に係る取引戦略の別を区分して当社に対し明らかにするものとします。
- 顧客が高速取引行為に係る市場デリバティブ取引を委託する場合には、その都度、高速取引行為に係る取引戦略の別を取引参加者に指示するものとします。

(備考)

- 業務規程第26条第1項第2号、J-NET市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例第3条第1項第2号等
- 受託契約準則第9条第1項第10号、J-NET市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例第11条第1項第8号等

2. 関連情報の提出

- (1) 高速取引行為を行う者の商号、名称又は氏名が確認できる証跡の写し
- 高速取引行為を行う者は、高速取引行為を行う者としての登録等の完了後、登録等した者の商号、名称又は氏名が確認できる証跡の写しを当社に速やかに提出するものとします。
- (2) 国内における代表者等の連絡先
- 顧客は高速取引行為を行う者としての登録等の完了後、国内における代表者等の氏名及び住所等を当社に速やかに届け出るものとします。

- 受託契約準則第35条第1項、取引参加者規程施行規則第5条第1項第1号の4

- 受託契約準則第35条第2項

(3) 業務方法書等の写し

- 金融商品取引業者、登録金融機関又は取引所取引許可業者は、高速取引行為を行う者としての変更登録等が完了した後、業務方法書の写しを当社に遅滞なく届け出るものとします。
- 高速取引行為者として登録を行った者は、業務方法書並びに業務に係る人的構成及び組織等の業務執行体制を記載した書面の写しを当社に遅滞なく届け出るものとします。

・受託契約準則第35条第3項、取引参加者規程施行規則第5条第1項第1号の4

3. 注文管理体制等の整備

(1) 注文管理体制の整備

- 取引参加者は、顧客の資力等を踏まえ、一定の時間における注文の数量又は金額の合計が一定の数量又は金額以上となる注文等の発注を防止するために適切と認められる制限を実施するものとします。

・取引参加者における注文管理体制に関する規則第4条第3号及び第6条第3号

(2) リスク管理体制の整備

- 取引参加者は、ポジションに関するリスク管理として、顧客の資力、属性、取引商品、取引形態及び取引規模等（取引参加者の自己の計算による取引にあっては、当該取引参加者の資力、取引形態及び取引規模等をいいます。）に照らし、当該顧客（取引参加者の自己の計算による取引にあっては、当該取引参加者をいいます。）における過大なポジションの発生を防止するために適切と認められる管理を実施するものとします。

・取引参加者規程施行規則第5条の5第2号

4. 受託に係る適切な措置

- 取引参加者は、顧客から当社の市場における高速取引行為に係る市場デリバティブ取引の委託を受けた場合には、当社が当該顧客に対して行う要請及び当社が日本取引所自主規制法人（以下「自主規制法人」といいます。）に委託した業務において自主規制法人が当該顧客に対して行う要請に当該顧客が応じるよう適切な措置を講じるものとします。

・取引参加者規程第19条の2

5. 自主規制業務の委託等

- 当社は、金融商品取引法第85条の5第2項の規定により自主規制業務とみなされた業務のうち、取引所金融市

・業務規程第2条の2第2項

場における市場デリバティブ取引の内容の審査に関する業務について、自主規制法人に委託することができるものとします。

- ・高速取引行為を行う顧客は、当社が自主規制法人に委託した業務について自主規制法人が当該顧客に対して行う要請に応じるものとします。

- ・受託契約準則第36条

6. その他

(1) ユーザID利用料の設定

- ・次のとおり、共用TAPに係るユーザID利用料を新たに設定します。
 - (a) MM管理ユーザID
・1個あたり3万円とします。
 - (b) TradeGuardユーザID
・4個まで0円、4個を超える部分につき1個当たり5万円とします。

- ・取引参加者料金等に関する規則別表3第1項第2号a

(2) 所要の修正

- ・その他所要の修正を行います。

III. 施行日

- ・2018年4月1日から施行します。

以 上