

カブドットコム証券株式会社
 (コード番号：8703 東証1部)
 代表執行役社長 齋藤 正勝

2010年7月16日

個人投資家向け初！コロケーション（大証先物オプション）を採用し取引環境を超高速度～ハイフリークエンシー取引・アルゴリズム取引に対応した高速化対応新システムを導入～

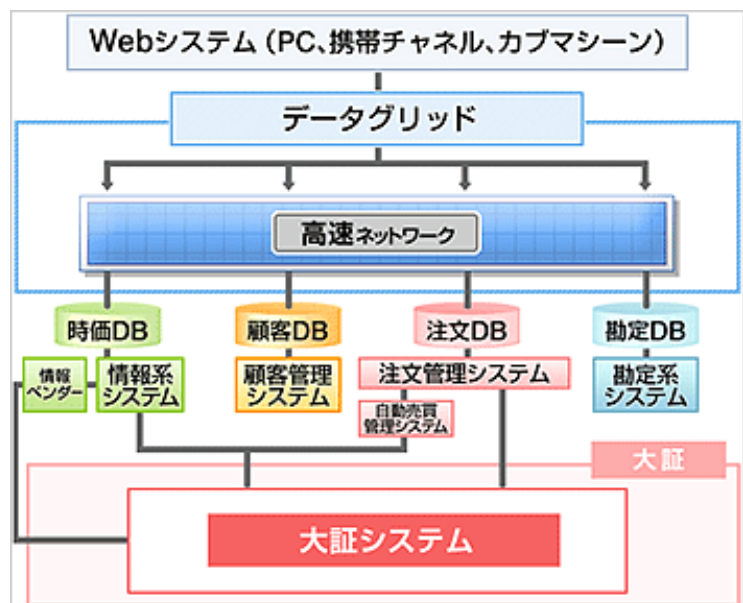
カブドットコム証券株式会社は、来年2011年に刷新される大阪証券取引所の次期デリバティブ売買システムに完全対応すべく、先物/オプション取引システムの刷新を行います。次期デリバティブ売買システムで採用されるNASDAQ OMX社の売買システムは、相場状況に応じて瞬時に大量の売買注文を出すハイフリークエンシー取引(高頻度取引)に対応したものであり、当社においても個人投資家向けのサービスとして、機関投資家と互角に渡り合える速度/品質を持つシステム提供のために、大阪証券取引所が提供するコロケーションサービス※1を採用し、個人投資家向けの最良かつ最速の取引環境を提供してまいります。これに先立って、2010年8月2日(月)より、先物/オプション取引システムにおいて、取次処理速度(板乗り速度)高速化のための新システムを導入いたします。株式においては、本年1月より、東証arrowhead(アローヘッド)対応として、システムの刷新を行っておりますが、この度は先物/オプション取引にも高速化のための新システムを導入いたします。新システムによる先物/オプション取引の取次処理速度は株式で達成した平均324ミリ秒(最速93ミリ秒)をさらに上回る速度を目標としております。

<2010年8月>

先物/オプション取引の受注時には証拠金をリアルタイムで計算する必要があります。この受注処理全体の約7割が必要証拠金計算のデータ取得のための時間として費やしています。今回、証拠金計算プログラムにおいて、データグリッドシステムを導入し、リアルタイムSPAN®による必要証拠金の計算をさらに高速化し、目標値として300ミリ秒以内に取引所に発注する事が可能となります。

※1 コロケーションサービス

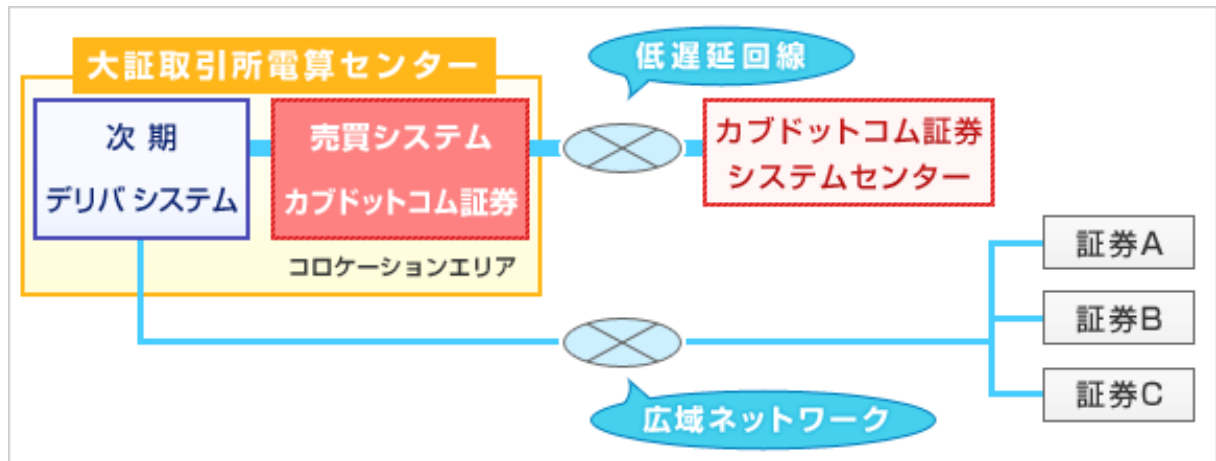
取引所の回線設備の整った施設に証券会社のコンピュータを設置する、取引所が提供するサービス。高速な回線をはじめとする設備を提供する事が可能。



●2011年の先物/オプション取引における当社システム構成(予定)について

大証新システムの稼動に伴い、大証取引所電算センター内のコロケーションエリアに、当社の条件注文に関する主要サーバ群を配置し、特に条件注文の値段トリガに対する反応速度を飛躍的に高め、取引所の値段合致から100ミリ秒以内に約定させる事を目標にしておりま

す。またカブドットコム証券システムセンターから大証取引所電算センターまでを1ミリ秒以内で転送できる低遅延回線を採用し、高頻度取引やアルゴリズム取引に最適なシステム基盤を構築する事になります。



●コロケーションサービスのメリット

ハイフリークエンシー取引においては、システムおよびネットワークが高速である必要があります。コンピュータの処理速度以上に時間が掛かるものとしてネットワークの処理速度があります。例えば東京都内同士の拠点間であっても、5ミリ秒程度のネットワーク遅延は発生します(一般的には距離に比例し、極めて至近距離であれば1ミリ秒以内も可能です)。5ミリ秒という時間の間には1つの約定が成立します。すなわち各社のシステムが同じように判断しても各社のコンピュータセンターと取引所との距離によっては出遅れが発生します。コロケーションサービスを利用すると、取引所と同じ場所に各証券会社のサーバを設置する事となり、ネットワーク遅延の問題が解決されます。コロケーションサービスは本来は証券会社のトレーディング部門向け、または機関投資家向けに利用される事を想定しておりましたが、当社は、これを個人投資家向けにもその恩恵を受けられるように、当社の先物/オプション取引システムの一部を切り出し、大阪証券取引所の電算室に当社サーバ群を設置する事といたしました。これにより、当社の日経225先物取引およびオプション取引における条件注文は極めて短い時間で、取引所に執行される事となります。