

THE ULTIMATE TRADE COMPLIANCE TOOL

TT® Score の機械学習技術を使って、比類のない精度で、規制措置のリスクが高い動作パターンを識別します。



最小限の労力で、会社のコンプライアンス リスクやトレーダーの動作の完全な透明性を取得できます。トレーダーの破壊的かつ意図的な取引操作が手遅れの問題になる前に、積極的な手順をとって問題を回避しましょう。

リスクの識別

高度なパターン識別や隠された脅威のフラグを使って、深刻な問題となる前に潜在的な高リスク操作を検出します。

違反の回避

違反が発生する前に、規制的かつコンプライアンスの問題を発見して、罰金や法的な捜査の対象にならないようにします。

操作の最適化

リスクの高い操作を優先して早く効果的に対処することで、コンプライアンスやリスク確認を標準化します。

アノマリーの検出

会社の取引操作内でヒストリカルトレンドや環境の事情を理解することで、概要イベントを検出します。

TT で即時に利用可能

全てのトレーダーの注文操作を即時に監視して評価し、個人が各自の操作を監視できるようにします。

他のプラットフォームのユーザーの監視

FIX Drop Copy を使って、任意のプラットフォームから TT プラットフォームに注文操作を取得し、永久に保存できます。

取引サーベイランスのための機械学習の利点

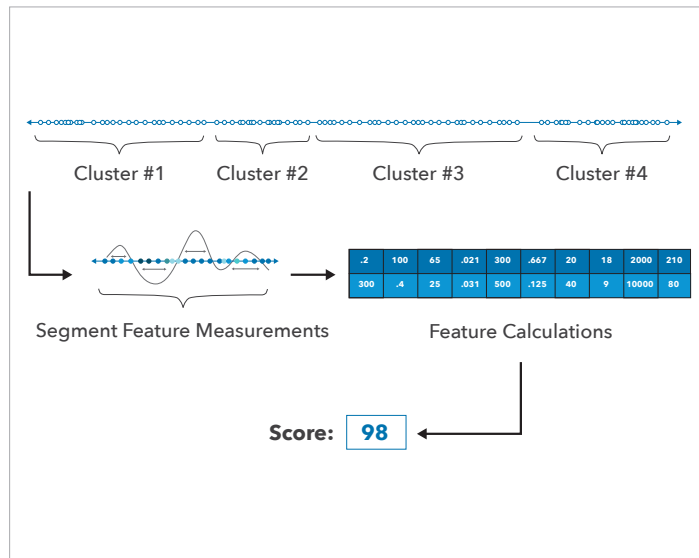
- ◆ 厳しい決定構造ではなく、ヒストリカル ケース データで、サーベイランス モデルを訓練します。
- ◆ 動作の意図に基づいて、取引操作の結果を集約します。
- ◆ 既知のケースからのパターンの類似に基づいて、すべてのトレーダー操作をスコア化します。

潜在的に問題のある複数の取引操作タイプを把握

- ◆ 乱用メッセージ
- ◆ モメンタム イグニッション
- ◆ 共謀スプーフィングと自動共謀スプーフィング
- ◆ 注文一覧の優位
- ◆ クロストレード
- ◆ ピニング
- ◆ ディール タイム
- ◆ 仮想売買
- ◆ 立会終了時の優位
- ◆ 往復ウォッシュトレード
- ◆ 取引開始時の優位
- ◆ 片側の注文一覧の優位
- ◆ 過剰売買
- ◆ スプーフィングと自動スプーフィング
- ◆ 取引所メッセージ率 限度
- ◆ ウォッシュトレード
- ◆ 最低価格と最高価格
- ◆ フロント ランニング
- ◆ 立会開始への影響要因
- ◆ 終値関与

クラスタとスコア

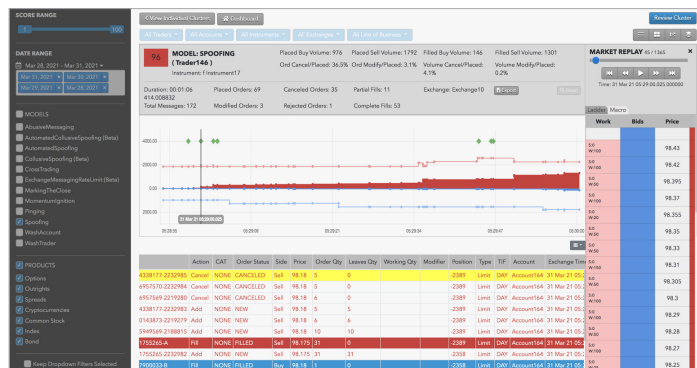
- ◆ TT Score のクラスタ アルゴリズムは、時間やトレーダー、金融銘柄やその他の注文操作の近接度などの要因に基づいて、注文操作を「クラスタ」に分離します。
- ◆ 各クラスタは、操作が関連している可能性の高い時間のスライスです。
- ◆ モデルは実際の規制ケースや調査からのデータを使って訓練されています。
- ◆ 一定期間にわたって順応する AI モデルでは、パラメータを設定する必要がありません。
- ◆ クラスタは、過去の規制操作に見られる算術的な類似性の程度に基づいてスコア化されています。
- ◆ 0 ~ 100 のスコア範囲は、既知のケースに非常に高い類似性を持っていることを示しています。



視覚化と調査

TT Score は、大量データを処理するように設計されたインターフェースと、ユーザーがリスクの評価と対処を容易に実行できる固有の視覚化ツールを活用して、処理後の取引データの分析と優先化ができるように作成されています。

- ◆ [Heat Map] には、規制措置の事例に非常に類似している取引操作を生成する、トレーダーや口座のハイライトが表示されます。
- ◆ Outlier チャートには、1画面での合計クラスターの表示に比較した、各会社のハイリスククラスターのパーセント数が表示されます。
- ◆ Scorecard では、クラスタの重要な統計の要約が表示される他、注文行為により形成されたパターンの初期の視覚化が表示されます。
- ◆ Market Ladder Replay は、ラダー形式のインターフェースでレベル 2 マーケット データに重ねて、取引行為をコマ送り再生できる機能を提供しています。
- ◆ Macro チャートでは、1画面にクラスタの全期間におけるトレーダーのデータとレベル 2 マーケット データの両方が表示されます。



TT Score に関する詳細情報や、お客様の用途に対応した製品デモに関しては、お近くのトレーディング・テクノロジーズ担当者に、または電子メールで sales@tradingtechnologies.com までお問い合わせください。