

# 究極のトレードコンプライアンスツール

TT® Score の機械学習テクノロジーを利用して、比類のない精度で最大の規制リスクを課する動作のパターンを識別できます。



最小限の労力で、会社のコンプライアンスリスクとトレーダーの操作を完全に把握することができます。破壊的かつ意図的なトレード操作を未然に防ぐため、問題になる前に対策を取ることができます。

## リスクの識別

高度パターン認識とフラグの隠された脅威を使用して、災害が発生する前に、潜在的な危険性の高い操作を検出して隠された脅威をフラグします。

## 違反の回避

違反が発生する前に、規制やコンプライアンスの問題を発見し、罰金や法的調査が起きないようにします。

## 操作の最適化

より早く効率的に高いリスクの操作を識別して、優先的に対処することで、コンプライアンスとリスク確認の最適化を図ります。

## 異常の検出

会社の取引活動内で、ヒストリカル動向や環境的背景、相関関係を理解することによって、異常な事象を検出します。

## TT での使用を即時に有効化

すべてのトレーダーの注文操作を即時に監視・評価でき、個々のトレーダーは各操作を監視できます。

## 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、永久保存できます。

## トレードサーベイランスの AI テクノロジーの利点

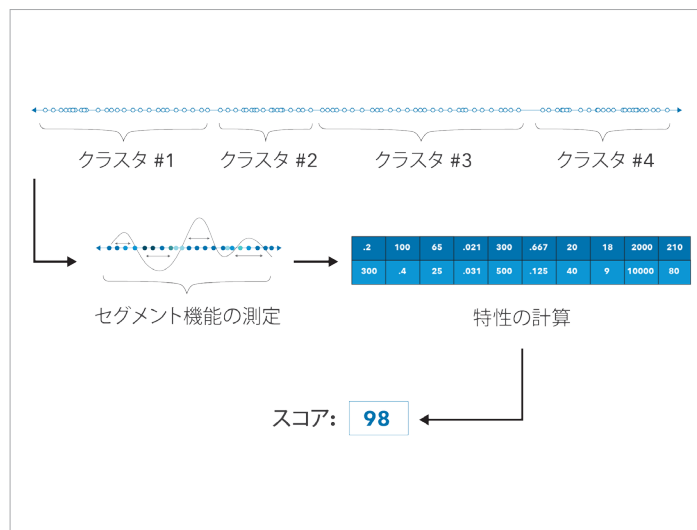
- ◆ ヒストリカル ケース データにより監視モデルを向上させます。厳密な決定木は不要です。
- ◆ 行動的意図に基づいて、取引行為の検証を集約します。
- ◆ 過去の事例とのパターン類似性に基づいて、すべての取引行為をスコア化します。

## 潜在的に問題のある複数タイプの取引の検出

- ◆ レイヤリング、フリッピング、バキューミングなどのスプーフィング動作
- ◆ 乱用メッセージ
- ◆ モメンタム イグニッション
- ◆ ピニングとフィッシング
- ◆ ウォッシュトレード

## クラスタとスコア

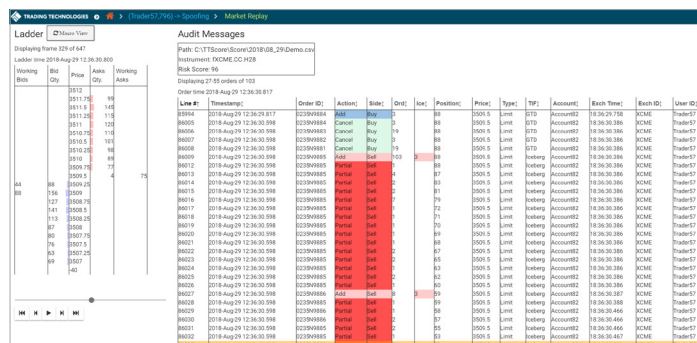
- ◆ TT Score のクラスタ アルゴリズムは、時間やトレーダー、銘柄及びその他の注文操作の近接度などの要因に基づいて、注文操作を「クラスタ」に分離します。
- ◆ 各クラスタとは、操作が関連している可能性のある時間のスライス切りを示します。
- ◆ モデルは、実際の規制のケースや調査からのデータを使って訓練されます。
- ◆ 長期にわたって適応する A.I (人工知能) モデルに関しては、パラメータ設定を行う必要はありません。
- ◆ クラスタは、過去の規制操作の数学的類似の程度に基づいてスコアが記録されます。
- ◆ スコアは 0~100点で表示され、点数が高くなればなるほど、既知のケースに非常に類似していることを示します。



## 視覚化と調査

TT Score は、大容量データを処理できるように設計されたインターフェイスと、リスクの評価と対応においてユーザーを支援する固有の視覚化により、取引後に処理される取引データの分析や優先順位付けを促進します。

- ◆ Heatmap には、規制のケースに非常に類似した操作を生成してい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の表示に比較した、各会社のハイリスククラスタ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、注文操作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 では、はしご形式のインターフェイスでレベル 2 のマーケット データを使って、重ね合わされた取引操作がコマ送り再生されます。
- ◆ Macro チャートには、1スクリーンのクラスタの全体の長さに対して、トレーダーのデータとレベル 2 のマーケット データの両方が表示されます。



TT Score とカスタム デモに関する詳細については、  
 トレーディング・テクノロジーズの社員、または [sales@tradingtechnologies.com](mailto:sales@tradingtechnologies.com) に  
 電子メールでお問い合わせください。