

# 取引所取引に係る約定取消しルール of 制定に伴う業務規程等の一部改正 について

平成19年9月26日  
株式会社名古屋証券取引所

## 1. 改正趣旨

誤注文により大量の売買が成立し、長期にわたって当該売買に係る決済が行われなくなる可能性が極めて高く、それにより市場が混乱するおそれがあると認められるときは、当取引所が売買を取り消すことができることとするなど、業務規程等について所要の改正を行うこととする。

## 2. 改正概要

(備 考)

### (1) 売買の取消し

売買の取消しの効果等

- ・ 当取引所は、過誤のある注文により、売買が成立した場合において、その決済が極めて困難であり、当取引所の市場が混乱するおそれがあると認めるときは、当取引所が定めるところにより、当取引所が定める売買を取り消すことができることとする。
- ・ 取り消された売買は、初めから成立しなかったものとみなす。また、取り消された売買に係る顧客と取引参加者との間の権利及び義務は、初めから発生しなかったものとみなす。
- ・ 取引参加者及び顧客は、売買の取消しにより損害を受けることがあっても、過誤のある注文を発注した取引参加者に対して、その損害の賠償を請求できないものとする。ただし、過誤のある注文の発注に際して、取引参加者に故意又は重過失が認められる場合は、この限りではないものとする。
- ・ 取引参加者及び顧客は、売買の取消しにより損害を受けることがあっても、当取引所に対して損害の賠償を請求できないものとする。ただし、当取引所に故意又は重過失が認められる場合は、この限りではないものとする。

売買の取消しの手続き等

- ・ 過誤のある注文を発注した取引参加者は、売買の取消しを行う可能性があることを周知するための売買の停止が行われた時又は当該注文について公表された時のいずれか早い時から、原則として60分を経過するまでの間に限り、売買の取消しの申請を行うことができる。
- ・ 上記の申請を行うことができるのは、以下の数量又は金額を超える売買が成立し、当該売買の決済が極めて困難である場合とする。

a 内国株券及び重複上場銘柄以外の外国株券

上場株式数の20% (当該売買の決済を特に困難とする状

況が認められる場合にあつては、上場株式数の10%)

b 外国株券(重複上場銘柄)等

それぞれ、次の(2)に定める売買の停止を行う数量又は金額

- ・当取引所は、上記の申請を行った取引参加者から事情を聴取する
- ・上記の場合のほか、当取引所は、過誤のある注文により成立した売買の決済が極めて困難であり、当取引所の市場が混乱することを回避するために必要と認める場合は、売買の取消しを行うこととする。

売買の取消しの範囲

- ・取り消される売買は、過誤のある注文に係る売買が最初に約定した時から、売買の取消しを行う可能性があることを周知するための売買の停止が行われた時(売買の停止が行われなかった場合にあっては、当該注文について公表された時)までの間に成立したすべての売買とする。

取消料

- ・売買の取消しが行われたときは、当該取消しに係る過誤のある注文を発注した取引参加者は、当取引所の定めるところにより取消料を納入しなければならないものとする。

(2) 売買の取消しを行う可能性を周知するための売買の停止

- ・当取引所は、過誤のある注文により、以下の数量又は金額を超える売買が成立した場合に、売買の取消しを行う可能性があることを周知させるため売買を停止するものとする。

a 内国株券及び重複上場銘柄以外の外国株券については、上場株式数の10%

b 外国株券(重複上場銘柄)については、売買単位の2万倍

c 転換社債型新株予約権付社債券については、額面金額20億円

- ・上記の売買の停止は、売買の取消しを行う場合は当取引所がその都度必要と認める期間とし、取消しを行わない場合は当取引所が売買の取消しを行わないことを発表した後30分を経過した時までとする。

(3) 復活のための売買

復活のための売買

- ・取引参加者は、顧客の注文が取り消されたときは、あらかじめ当取引所の承認を受け、取り消された売買と同じ値段により、過誤のある注文を発注した取引参加者を相手方として、

・業務規程施行規則第12条第1項第2号等

・業務規程施行規則第12条第2項等

・業務規程施行規則第13条等

・取引参加者規程第12条、取引参加者負担金等に関する規則第4条の2

・業務規程第28条第5号等、業務規程施行規則第21条等

・業務規程施行規則第20条

・業務規程第40条の2

当該承認に係る売付け又は買付けを執行することができるものとする。

#### 承認条件等

- ・上記の承認を受けようとする取引参加者は、当取引所が定める様式により申請を行い、当取引所は、以下のいずれにも該当する場合に、これを承認するものとする。

a 過誤のある注文に係る売買が最初に約定した時から、売買の取消しを行う可能性があることを周知するための売買の停止が行われた時（売買の停止が行われなかった場合にあっては、当該注文について公表された時）までの間に、次のいずれかの売買（以下「連鎖取引」といいます。）を行っていること

(a) 当該取り消された売買に係る注文を委託した取引参加者と同一の取引参加者に委託して行った、当該取り消された売買に係る売付け後の売却代金による買付け又は買付け後の当該買い付けた有価証券の売付け

(b) 信用取引の弁済（弁済の繰延期限にあたる日における弁済に限る。）のための売買

(c) 株券オプション取引の権利行使により成立する対象株券の売買の決済のための売買

b 取り消された売買に係る売付け又は買付けが、取引一任契約又は金融商品取引業者の自己の計算に基づき行われたものでないこと

c 売買の取消しが行われたことにより、委託者が連鎖取引の決済を行うことができなくなること

#### 復活のための売買の上限数量

- ・復活のための売買は、顧客ごとに、2千万円を取り消された売買に係る銘柄の当該売買が行われた日における基準値段で除して得た数量を、当該銘柄の売買単位で除して得た数量（10に満たない端数は切り上げる。）を上限とする。

・業務規程施行規則第26条の2第1項、第2項等

・業務規程施行規則第26条の2第3項

### 3. 施行日

平成19年9月30日から施行する。

以 上