

N-NET市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例の施行規則

(平成23.7.19実施)

(目的)

第1条 この規則は、N-NET市場に関する業務規程及び受託契約準則の特例（以下「N-NET特例」という。）に基づき、当取引所が定める事項について規定する。

(単一銘柄取引の数量等)

第2条 N-NET特例第3条第1項に規定する当取引所が定める数量又は金額は、次の各号に定めるところによるものとする。

(1) 株券

業務規程第15条第1号及び第2号に定める数量

(2) 転換社債型新株予約権付社債券

業務規程第15条第5号に定める金額

(バスケット取引の銘柄数等)

第3条 N-NET特例第3条第2項に規定する当取引所が定める銘柄数は15銘柄とし、当取引所が定める金額は1億円とする。

(単一銘柄取引の値段)

第4条 N-NET特例第8条第3項第1号に規定する当取引所が定める値段は、次の各号に定める値段とする。

(1) 株券

普通取引（当取引所又は株式会社東京証券取引所における売買立会による売買の普通取引をいう。以下同じ。）における直前の約定値段（呼値に関する規則第12条から第14条までの規定により気配表示された気配値段及び株式会社東京証券取引所が定めるところにより気配表示が行われている場合の当該気配値段を含む。前日（休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。）に普通取引における約定値段（同第12条及び同第13条の規定により気配表示された気配値段を含む。）がない場合その他当取引所が当該直前の約定値段によることが適当でないと認める場合で、当日の普通取引における売買立会の始めの約定値段（同第12条及び同第13条の規定により気配表示された気配値段を含む。この条において同じ。）が決定される以前においては、呼値の制限値幅に関する規則第4条に規定する呼値の制限値幅の基準値段。以下次条までにおいて同じ。）から当該約定値段に100分の7を乗じて算出した額を減じて得た値段から、当該約定値段に100分の7を乗じて算出した額を当該約定値段に加えて得た値段までの範囲内の1円の1万分の1の整数倍の値段とする。この場合において、売買代金は、円位未満の端数を切り捨てるものとする。

(2) 転換社債型新株予約権付社債券

前号の規定は、転換社債型新株予約権付社債券について準用する。この場合において、「1円の1万分の1の整数倍の値段」とあるのは「額面100円につき1銭の100分の1の整数倍の値段」と読み替えるものとする。

- 2 前項の規定にかかわらず、N-NET特例第7条第1号に規定する日に決済を行う取引について、次の各号に掲げる期間における値段は、当取引所がその都度定める。
- (1) 普通取引における業務規程第25条第1項の規定により定める配当落等の期日、同第25条の2の規定により定める株式併合後の株券の売買開始の期日又は同第26条の規定により定める取得対価の変更期日から、当該期日から起算して3日目（休業日を除外する。以下日数計算について同じ。）の日以降の普通取引の売買立会の始めの約定値段が決定される時まで
 - (2) 業務規程第26条の規定により定める行使条件の変更期日又は同第26条の2の規定により定める期中償還請求権に係る権利落として売買を行う期日から、当該期日から起算して4日目の日（利付転換社債型新株予約権付社債券の売買について、同第9条第5項に定める場合には、当該期日から起算して5日目の日とする。）以降の普通取引の売買立会の始めの約定値段が決定される時まで
- 3 第1項の規定にかかわらず、N-NET特例第7条第2号に規定する日に決済を行う取引について、普通取引における業務規程第25条第1項の規定により定める配当落等の期日、同第25条の2の規定により定める株式併合後の株券の売買開始の期日、同第26条の規定により定める取得対価の変更期日若しくは行使条件の変更期日又は同第26条の2の規定により定める期中償還請求権に係る権利落として売買を行う期日の午前8時20分から普通取引の売買立会の始めの約定値段が決定される時までにおける値段は、当取引所がその都度定める。
- (平成31.7.16変更)

(バスケット取引の代金)

第5条 N-NET特例第8条第3項第2号に規定する当取引所が定めるバスケット取引に係る代金は、次の各号に定める代金とする。

(1) 株券

当該バスケット取引により売買が行われる銘柄（以下「バスケット構成銘柄」という。）の各銘柄について、普通取引における直前の約定値段に当該銘柄に係る売付数量又は買付数量を乗じて得た額を合計した額から当該合計した額に100分の5を乗じて算出した額を減じて得た金額から、当該合計した額に100分の5を乗じて算出した額を当該合計した額に加えて得た金額までの範囲内の金額とする。この場合において、バスケット構成銘柄の各銘柄の値段は、1株につき1円とする。

(2) 転換社債型新株予約権付社債券

前号の規定は、転換社債型新株予約権付社債券について準用する。この場合において、「売付数量」とあるのは「売付額面金額の100分の1」と、「買付数量」とあるのは「買付額面金額の100分の1」と、「1株につき1円」とあるのは「額面100円につき1銭の整数倍」と読み替えるものとする。

2 前条第2項及び第3項の規定は、前項のバスケット取引に係る代金について準用する。

3 第1項の規定にかかわらず、第1項の規定により定めるバスケット構成銘柄の各銘柄の値段でバスケット取引を行うことが適当でない場合又は普通取引において約定値段がない場合は、当取引所がその都度定める。

(平成31.7.16変更)

(呼値に関する事項)

第6条 N-NET特例第8条第5項の規定により、N-NET取引の呼値に関し当取引所が定める事項は、

次の各号に定める事項とする。

(1) 決済日の区別の指定

単一銘柄取引又はバスケット取引の呼値を行うときは、N-NET特例第7条に規定する決済日の区別を指定するものとする。

(2) 呼値の効力

単一銘柄取引及びバスケット取引の呼値は、当該呼値が行われた時から当取引所が定める一定時間経過時又はN-NET特例第9条第1項各号に定める取引時間終了時のいずれか早い時に、終値取引の呼値はN-NET特例第10条第1項各号に定める取引時間終了時に、それぞれ効力を失うものとする。ただし、N-NET特例第18条各号の規定により、N-NET取引に係る売買の停止が行われた場合の呼値の効力については、当取引所がこれを失わせることができる。

(3) 呼値の制限

取引参加者は、次のa及びbに掲げる銘柄について、当取引所又はN-NET特例第8条第3項第3号aに定める指定取引所における売買立会による売買において上場後最初の約定値段が決定されるまでは、呼値を行ってはならない。

a 株券（当取引所又は国内の他の金融商品取引所において上場されている銘柄を除く。）のうち新たに上場された銘柄（当取引所がその都度指定する銘柄を除く。）

b 転換社債型新株予約権付社債券で新たに上場された銘柄のうち、上場日の直前に国内の他の金融商品取引所に上場されていた銘柄（上場会社が、他の上場会社又は国内の他の金融商品取引所に株券が上場されていた非上場会社を吸収合併する場合において、被合併会社が発行した転換社債型新株予約権付社債券が当該合併により当取引所又は国内の他の金融商品取引所において上場廃止された後、存続会社の発行する転換社債型新株予約権付社債券として新たに上場された銘柄を含む。）以外の銘柄

(4) 呼値の方法

呼値は、取引参加者端末装置等からその内容を入力することにより行うものとする。

（平成31.7.16、令和3.4.26変更）

（終値取引の呼値の順位）

第7条 N-NET特例第10条第2項第2号に規定する同時に行われた呼値の順位は、売買システムでの記録順序とする。

（自己株式立会外買付取引の届出）

第8条 N-NET特例第11条第2項の規定による届出は、当取引所が定める様式により、売買立会終了後、直ちに行うものとする。

第9条 削 除（平成31.7.16変更）

（自己株式立会外買付取引に係る基準値段）

第10条 N-NET特例第12条に規定する当取引所が定める基準値段は、呼値の制限値幅に関する規則別表「基準値段算出に関する表」により算出された値段とする。

(自己株式立会外買付取引の売付申込み)

第11条 N-NET特例第13条に規定する自己株式立会外買付取引に対する売付けの申込みは、次の各号に定めるところにより行うものとする。

(1) 売付申込みの方法

自己株式立会外買付取引に対する売付けの申込みは、その内容を、取引参加者端末装置から入力する方法により当取引所に通知することにより行うものとする。

(2) 売付申込数量の単位

売付申込数量の単位は、当該銘柄の売買立会による売買単位に準ずるものとする。

2 第6条第2号ただし書の規定は、自己株式立会外買付取引に対する売付けの申込みについて準用する。

(令和3.4.26変更)

(自己株式立会外買付取引における対当順位)

第12条 N-NET特例第14条に規定する当取引所が定める順位は、次の各号に定めるところによる。

(1) 対当の順位は次のとおりとする。

a 第1順位

顧客（金融商品取引業者（法第28条第1項第1号に掲げる行為に係る業務の登録を受けた者に限る。以下この号において同じ。）を除く。）からの委託に基づく売付申込数量

b 第2順位

金融商品取引業者の自己の計算に基づく売付申込数量

(2) 前号a及びbに規定するそれぞれの売付申込数量の対当順位は、次のとおりとする。この場合において、同一取引参加者の売付申込数量が買付けの総数量を超えているときは、当該売付申込数量は、買付けの総数量と同数量とする。

a 売付けの申込みを行っている取引参加者単位により申込数量の多い取引参加者から少ない取引参加者の順序（申込数量が同一の取引参加者については、売買システムでの記録順序）で最小単位をそれ以外の部分の数量に優先させ、対当させる。

b 最小単位以外の数量については、取引参加者単位でその数量に比例させ、対当させる。ただし、最小単位未満の端数が生じた場合は、その端数を切り捨てる。

(3) 前号bただし書の規定により切り捨てた分については、切捨数量の多い取引参加者から最小単位を順次対当させる。ただし、その数量が同一の取引参加者については、売買システムでの記録順序により対当させる。

(N-NET取引に係る売買の取消し)

第13条 N-NET特例第17条第1項の規定により行うN-NET取引に係る売買の取消しは、次の各号に定めるところによる。

(1) 過誤のある注文を発注した取引参加者は、過誤のある注文により次のaからcまでに定める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には、業務規程第28条第5号の規定により売買立会による売買が停止された時、N-NET特例第18条第5号の規定によりN-NET取引

に係る売買が停止された時又は業務規程第78条の2の規定により当該過誤のある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、当取引所の定める様式により、売買の取消しの申請を行うことができる。

- a 内国株券（内国法人の発行する株券、内国法人の発行する新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券をいう。以下同じ。）

第16条第1号に定める数量に2を乗じて得た数量（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っては、同号に定める数量）

- b 外国株券

- (a) 重複上場外国銘柄（外国の金融商品取引所又は組織された店頭市場（以下「外国金融商品取引所等」という。）において上場又は継続的に取引されている外国株券をいう。以下同じ。）

第16条第2号aに定める数量

- (b) 前(a)以外の銘柄

第16条第2号bに定める数量に2を乗じて得た数量（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っては、同号に定める数量）

- c 転換社債型新株予約権付社債券

第16条第3号に定める金額

- (2) 当取引所は、前号の申請が行われた場合において、当該申請を行った取引参加者から事情を聴取し、当該申請に係る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おそれがあると認めるときは、売買の取消しを行う。

- 2 前項に規定するほか、当取引所は、過誤のある注文により成立したN-NET取引に係る売買の決済が困難であり、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、N-NET特例第17条第1項の規定によりN-NET取引に係る売買の取消しを行う。

（N-NET取引に係る売買の取消しの範囲）

第14条 N-NET特例第17条第1項に規定する当取引所が定めるN-NET取引に係る売買は、過誤のある注文に係る売買が最初に成立した時からN-NET特例第18条第5号の規定により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、業務規程第78条の2の規定により当該過誤のある注文について公表された時）までに成立したすべての売買（当該過誤のある注文が発注された銘柄の売買に限る。）とする。

（売買の停止）

第15条 N-NET特例第18条各号に掲げる場合の売買の停止は、当取引所がその都度必要と認める期間とする。

（取消しの可能性の周知が必要と認める場合）

第16条 N-NET特例第18条第5号に掲げる場合のN-NET取引に係る売買の停止を行う場合は、原則として、過誤のある注文により、次の各号に掲げる有価証券の区分に従い、当該各号に定める数量又は金額を超える数量又は金額の売買が成立した場合とする。

(1) 内国株券

上場株式数（投資信託受益証券の場合は上場受益権口数をいう。）の10%に相当する数量

(2) 外国株券

a 重複上場外国銘柄

売買単位の2万倍に相当する数量

b 前a以外の銘柄

上場株式数（外国投資信託受益証券の場合は上場受益権口数をいい、外国投資証券の場合は上場投資口口数（投資法人債券に類する外国投資証券にあつては、当該外国投資証券の数量をいう。）をいう。）の10%に相当する数量

(3) 転換社債型新株予約権付社債券

額面金額20億円

（過誤訂正等のための売買の承認申請）

第17条 N-NET特例第19条の規定により当取引所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うものとする。

（復活のための売買）

第18条 N-NET特例第20条の規定により当取引所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うものとする。

2 前項の申請について、当取引所は、次の各号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。

(1) 過誤のある注文に係る売買が最初に成立した時からN-NET特例第18条第5号の規定により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つては、業務規程第78条の2の規定により当該過誤のある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」という。）を行っていること。

a 取り消された売買に係る注文を委託した顧客が、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 信用取引により貸付けを受けた買付代金又は売付有価証券の弁済（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 有価証券オプション取引の権利行使により成立する対象有価証券の売買の決済のための売買

(2) 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（法第28条第1項第1号に掲げる行為に係る業務の登録を受けた者に限る。）の自己の計算に基づき行われたものでないこと。

(3) 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。

3 復活のための売買は、顧客ごとに、次の各号に掲げる有価証券の区分に従い、当該各号に定める数量を上限とする。ただし、当該顧客について業務規程施行規則第26条の2第1項に規定する申請を行うときは、業務規程第40条の2第1項の売買及びN-NET特例第20条第1項の売買の合計について、当該上限を適用するものとする。

(1) 株券

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（基準値段がない場合には、当取引所がその都度定める値段。次号において同じ。）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。）

(2) 転換社債型新株予約権付社債券

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金額を、当該銘柄の額面金額で除して得た数量に100を乗じて得た数量（10に満たない端数は切り上げる。）

(総売買高等の通知及び公表)

第19条 N-NET特例第21条に定める当取引所の定める金額は、50億円とし、当取引所の定める日時は、当該取引成立の日の翌日の午後4時30分とする。

付 則

- 1 この規則は、平成23年7月19日から施行する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この規則は、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、規則に従い売買を行うことが適当でないと当取引所が認める場合には、平成23年7月19日以後の当取引所が定める日から施行する。

付 則

- 1 この改正規定は、平成31年7月16日から施行し、この改正規定施行の日以後に繰り延べる有価証券の引渡しから適用する。
- 2 前項の規定にかかわらず、この改正規定は、売買システムの稼働に支障が生じた場合その他やむを得ない事由により、平成31年7月16日から施行することが適当でないと当取引所が認める場合には、同日以後の当取引所が定める日から施行する。

付 則

この改正規定は、令和3年4月26日から施行する。

(変更)

[平成31.7.16、令和3.4.26]