

## 空売り価格規制に係るトリガー抵触銘柄の公表について

平成25年10月8日

株式会社名古屋証券取引所

### 1. 概要

本年11月5日（火）に施行が予定されております、空売り規制の総合的な見直しにおいて、現在、全ての銘柄に恒常的に適用されている価格規制体系から、一定の条件を満たした銘柄にのみ価格規制が適用されるという、トリガー型の価格規制体系に見直されることとなります<sup>1</sup>。

取引しようとしている銘柄に価格規制が適用されているかどうかという情報は、投資判断上、重要なものと考えられることから、当取引所では、対象となる銘柄の価格規制の適用状態について、相場報道システム（FLEXデータ・フィード）を通じて、リアルタイムに周知することとしておりますが<sup>2</sup>、併せて、市場関係者の利便性等を考慮し、当日にトリガーに抵触した銘柄の一覧情報について、EXCELファイル形式の単一のファイルとして、日々、当取引所のホームページに掲載することといたします。

公表方法や公表フォーマット等の詳細については下記2、その実施時期については下記3をそれぞれご参照ください。

### 2. トリガー抵触銘柄一覧の公表について

#### (1) 見直し後の価格規制体系について

空売り規制の総合的な見直しの施行後は、当日の価格規制について、金融商品取引法施行令（昭和40年政令第321号。以下「金商法施行令」という。）第26条の4第1項第1号及び有価証券の取引等の規制に関する内閣府令（平成19年内閣府令第59号。以下「取引規制府令」という。）第12条第5項に基づき、空売りに係る銘柄について、前日終値等を基礎として算出される基準価格<sup>3</sup>から10%以上低い価格で約定が発生した場合（以下、「トリガーに抵触した場合」等と記載します。）に、価格規制が適用されることとなります。

また、価格規制の翌日適用の有無については、金商法施行令第26条の4第1項第2号及び取引規制布令第12条第7項に基づき、当日の当該銘柄の主たる市場におけるトリガー抵触状況に応じて、決定されることとなります。すなわち、当日、当該銘柄の主たる市場においてトリガーに抵触した場合、その翌日は当該銘柄の取引が行われる全ての市場（私設取引システム（以下、「PTS」という。）を含む。）において、価格規制が終日適用されることとなります（各市場に

---

<sup>1</sup> 空売り規制の総合的な見直しの詳細につきましては、金融庁のホームページ（<http://www.fsa.go.jp/news/25/syouken/20130821-3.html>）をご参照ください。

<sup>2</sup> 詳細については、平成25年5月28日付「空売り規制の総合的な見直しに係る当取引所の対応について」（名証市場第36号）の別紙における2（12）をご参照ください。

<sup>3</sup> 当該基準価格について、当取引所では、当日の「呼値の制限値幅の基準値段」と同じ値段とすることとしております（以下、基準価格に係る記載について同じ。）。詳細については、平成25年5月28日付「空売り規制の総合的な見直しに係る当取引所の対応について」（名証市場第36号）の別紙における2（2）をご参照ください。

において、当日にトリガーに抵触したかどうかは問いません。)。その一方で、当該銘柄の主たる市場においてトリガーに抵触しなかった場合、その翌日は当該銘柄の取引が行われる全ての市場（PTSを含む。）において、価格規制が適用されていない状態で取引が開始されることとなります（各市場において、当日にトリガーに抵触したかどうかは問いません。）。

## (2) 公表方法について

上記(1)のように価格規制体系が見直される中、当取引所では、当日にトリガーに抵触した銘柄の一覧を取り纏めたうえで、EXCELファイル形式の単一のファイルとして、当日の午後4時30分を目途に、下記の当取引所のホームページに掲載いたします。

空売り価格規制トリガー抵触銘柄に関する情報

<http://www.nse.or.jp/market/condition/trigger/>

## (3) 公表フォーマットについて

トリガー抵触銘柄一覧の公表に係る公表フォーマットにつきましては、下記の当取引所のホームページよりダウンロードすることができます。

空売り価格規制トリガー抵触銘柄一覧の公表に係るフォーマット

<http://www.nse.or.jp/market/condition/trigger/>

## (4) 公表フォーマットに記載される情報について

空売り価格規制トリガー抵触銘柄一覧 List of Triggered Stocks for Short Selling Price Test			
<small>※ 下表におけるトリガー抵触時刻は、名古屋証券取引所の市場における抵触時刻を表示しております。 Note: "Triggered Time" indicated below shows a triggered time in the Nagoya Stock Exchange's market.</small>			
取引年月日 Date of Trading	①		
銘柄コード Code of Stock	銘柄名 (日本語/英語) Name of Stock (Japanese / English)	トリガー抵触時刻 Triggered Time	主たる市場 (日本語/英語) Primary Listing Market (Japanese / English)
②	③	④	⑤

### ①取引年月日 (Date of Trading)

当該ファイルに記載される情報の取引年月日が記載されます。

### ②銘柄コード (Code of Stock)

当日にトリガーに抵触した銘柄の銘柄コードが記載されます。

### ③銘柄名 (Name of Stock)

当日にトリガーに抵触した銘柄の銘柄名が記載されます。日本語の銘柄名及び英語の銘柄名が併記される方式となります。

### ④トリガー抵触時刻 (Triggered Time)

当日にトリガーに抵触した銘柄の、当取引所の市場におけるトリガー抵触時刻が秒単位で記載されます。例えば、当取引所に上場する銘柄について、当取引所の市場で午後1時14分31秒台にトリガーに抵触した場合、「13:14:31」と記載されます。

なお、当該トリガー抵触時刻は、「前日終値等を基礎として算出される基準価格から10%以上低い価格で、当日最初に約定した時刻」が記載されるものであり、必ずしも当日中に価格規制が適用開始となった時刻を意味するものではないことにご留意ください。例えば、当取引所が主たる市場である銘柄に関し、前日にトリガーに抵触し当日は終日価格規制が適用されている状態であったとしても、当日に再びトリガーに抵触した場合（前日終値等を基礎として算出される基準価格から10%以上低い価格での約定があった場合）には、そのトリガー抵触時刻が記載されることとなります。

また、当該一覧に記載された銘柄であったとしても、必ずしもその翌日に価格規制が終日適用となることを意味するものではないことにご留意ください。価格規制の翌日適用の有無については、対象となる銘柄の主たる市場において、当日にトリガーに抵触したかどうかによって決定されるため、当該一覧にトリガー抵触時刻が記載された銘柄であったとしても、その主たる市場が当取引所以外の銘柄については、当該銘柄の主たる市場における当日のトリガー抵触状況を確認する必要があります。

### ⑤主たる市場 (Primary Listing Market)

当日にトリガーに抵触した銘柄の主たる市場が記載されます。日本語の主たる市場及び英語の主たる市場が併記される方式となります。なお、主たる市場については、市場名ではなく取引所名を略記した形で記載されます。すなわち、当取引所が開設する市場であれば「名古屋」及び「Nagoya」と、東証が開設する市場であれば「東京」及び「Tokyo」と、福証が開設する市場であれば「福岡」及び「Fukuoka」と、札証が開設する市場であれば「札幌」及び「Sapporo」と、それぞれ記載されます。

#### (5) ファイルの公表に当たっての留意事項

- ✓ トリガー抵触銘柄一覧の公表については、施行日以降のもののみを対象とし、過去に遡及しての取り纏め及びその公表は行いません。
- ✓ トリガー抵触銘柄一覧の取り纏めの対象となる銘柄は、当取引所に上場している銘柄（単独上場銘柄及び重複上場銘柄）とします。

### 3. 実施時期について

トリガー抵触銘柄一覧については、本年11月1日（金）から公表を開始いたします<sup>4</sup>。

以 上

---

<sup>4</sup> 金商法施行令第26条の4第1項第2号に基づき、施行日の前営業日である本年11月1日（金）から、トリガー抵触銘柄一覧の公表を開始いたします。詳細につきましては、平成25年10月8日付「空売り規制の総合的な見直しに係る空売り残高報告の取扱い等について」（名証市場（業務）第80号）の別紙3「施行日当日の空売り価格規制の適用について」をご参照ください。