

【公報種別】特許法第17条の2の規定による補正の掲載

【部門区分】第6部門第3区分

【発行日】令和5年6月27日(2023.6.27)

【公開番号】特開2023-11917(P2023-11917A)

【公開日】令和5年1月24日(2023.1.24)

【年通号数】公開公報(特許)2023-014

【出願番号】特願2022-180080(P2022-180080)

【国際特許分類】

G 06 Q 40/04 (2012.01)

10

【F I】

G 06 Q 40/04

【手続補正書】

【提出日】令和5年6月19日(2023.6.19)

【手続補正1】

【補正対象書類名】特許請求の範囲

【補正対象項目名】全文

【補正方法】変更

【補正の内容】

20

【特許請求の範囲】

【請求項1】

相場価格の変動する金融商品の取引を行う金融商品取引管理装置であって、

金融商品を注文するための注文情報を生成する注文情報生成手段と、

前記金融商品の約定を管理する約定管理手段とを備え、

前記注文情報によって形成された、一部又は全部を約定可能な第一注文と、該第一注文が約定して保有するポジションを約定によって決済させる、一部又は全部を約定可能な第二注文とのうちの、前記第一注文のうちの一部のみ、及び／又は、前記第二注文のうちの一部のみが約定の条件を満たし、条件を満たした一部の前記第一注文のみ、及び／又は、条件を満たした一部の前記第二注文のみに対し、前記約定管理手段によって約定する処理が行われた場合、

30

前記注文情報生成手段は、

前記約定する処理が行われた一部の前記第一注文に対応する一部の前記第二注文を発注させる処理、及び／又は、前記約定する処理が行われた一部の前記第二注文に対応する一部の前記第一注文を発注させる処理、を行うことを特徴とする金融商品取引管理装置。

【請求項2】

前記約定管理手段は、

約定によって前記ポジションを保有する前記第一注文と約定によって前記ポジションを決済させる前記第二注文とにおいて、前記第一注文が約定した時、又は、前記第一注文が約定した後の所定のタイミング、又は、前記第二注文が約定した時、又は、前記第二注文が約定した後の所定のタイミング、の何れかの時点において、前記第二注文を、前記約定した前記第一注文に対応して約定させる一部の第二注文と、前記約定した前記第一注文に対応して約定させない他の一部の第二注文とに分裂させることを特徴とする請求項1に記載の金融商品取引管理装置。

40

【請求項3】

前記約定管理手段は、

約定によって前記ポジションを保有する前記第一注文と約定によって前記ポジションを決済させる前記第二注文とにおいて、該第一注文が約定した時、又は、前記第一注文が約定した後の所定のタイミング、又は、前記第二注文が約定した時、又は、前記第二注文が約定した後の所定のタイミング、の何れかの時点において、前記第一注文を、約定した前記第一注文に対応して約定させる一部の第二注文と、前記約定した前記第一注文に対応して約定させない他の一部の第二注文とに分裂させることを特徴とする請求項1に記載の金融商品取引管理装置。

50

記第一注文と、未約定の前記第一注文とに分裂させることを特徴とする請求項 1 又は 2 に記載の金融商品取引管理装置。

【請求項 4】

前記約定管理手段は、前記注文情報が第一注文と第二注文とをそれぞれ形成し、前記第一注文の一部のみが約定してポジションを保有した場合、前記ポジションを保有した一部の前記第一注文、又は該一部の第一注文が分裂する場合における該分裂が起きる前の前記第一注文と、前記ポジションを保有した一部の前記第一注文の前記ポジションを約定によって決済させる一部の前記第二注文とを対応させた状態とすることを特徴とする請求項 1 乃至 3 の何れか一つに記載の金融商品取引管理装置。

【請求項 5】

前記注文情報生成手段は、第一注文と第二注文とをそれぞれ発注するための前記注文情報を生成し、第一注文の前記注文情報に基づく前記ポジションの保有と第二注文の前記注文情報に基づく前記ポジションの決済とを繰り返し行わせて、

前記約定管理手段は、

前記第一注文と前記第二注文について、

前記繰り返しが行われる前の前記第一注文及び / 又は前記第二注文のうちの一部のみが約定した場合、繰り返される前記第一注文及び / 又は第二注文を、前記繰り返しの前ににおける約定された前記注文と未約定の前記注文の区分が維持された態様とすることを特徴とする請求項 1 乃至 4 の何れか一つに記載の金融商品取引管理装置。

【請求項 6】

前記注文情報生成手段は、前記第一注文と前記第二注文とをそれぞれ複数の価格にて発注するための注文情報として生成し、

前記約定管理手段は、前記第一注文の価格と、該第一注文に対応する前記第二注文の価格との間の価格帯を複数設け、複数の前記価格帯のうち少なくとも何れか一つの前記価格帯において前記第一注文と前記第二注文とを繰り返し行うことを特徴とする請求項 5 に記載の金融商品取引管理装置。

【請求項 7】

前記注文情報生成手段は、特定の上限価格と特定の下限価格の間に形成される価格範囲に一又は複数の前記価格帯を設定することを特徴とする請求項 6 に記載の金融商品取引管理装置。

【請求項 8】

前記注文情報生成手段は、前記第一注文としての前記注文情報を、前記第一注文が前記ポジションを保有する基準となる価格として設定された第一注文価格に対し、前記相場価格が、前記第一注文価格を超えて下落又は上昇したのちに再度前記第一注文価格以上又は以下となった後に前記ポジションを保有するように設定し、

前記第二注文としての前記注文情報を、前記第二注文によって前記ポジションを決済する基準となる価格として設定された第二注文価格に対し、前記相場価格が、前記第二注文価格を超えて上昇又は下落したのちに再度前記第二注文価格以下又は以上となった後に前記ポジションを決済するように設定し、

前記第二注文である前記注文情報は、トレール幅情報を備え、

前記第二注文である前記注文情報は、前記トレール幅情報に基づいて上昇方向又は下落方向に移動するように設定されたことを特徴とする請求項 1 乃至 7 の何れか一つに記載の金融商品取引管理装置。

【請求項 9】

前記注文情報が所定の前記相場価格に一致した後に前記注文情報を約定させる約定情報生成手段を備えたことを特徴とする請求項 1 乃至 8 の何れか一つに記載の金融商品取引管理装置。

【請求項 10】

前記金融商品の取引を行う取引者の、所定の口座における資金の残高の情報としての資金情報を管理する資金管理手段を備え、

10

20

30

40

50

前記約定情報生成手段は、前記資金情報を確認し、前記資金の残高が前記金融商品の約定に必要な金額未満の場合は、同一の価格において発注された前記注文情報に基づく前記注文のうちの一部の前記注文のみを約定させることを特徴とする請求項9に記載の金融商品取引管理装置。

【請求項11】

相場価格の変動する金融商品の取引を行う金融商品取引管理システムであって、  
金融商品を注文するための注文情報を生成する注文情報生成手段と、  
前記金融商品の約定を管理する約定管理手段とを備え、  
前記注文情報によって形成された、一部又は全部を約定可能な第一注文と、該第一注文  
が約定して保有するポジションを約定によって決済させる、一部又は全部を約定可能な第二注文とのうちの、前記第一注文のうちの一部のみ、及び／又は、前記第二注文のうちの一部のみが約定の条件を満たし、条件を満たした一部の前記第一注文のみ、及び／又は、条件を満たした一部の前記第二注文のみに対し、前記約定管理手段によって約定する処理が行われた場合。

前記注文情報生成手段は、  
前記約定する処理が行われた一部の前記第一注文に対応する一部の前記第二注文を発注させる処理、及び／又は、前記約定する処理が行われた一部の前記第二注文に対応する一部の前記第一注文を発注させる処理を行うことを特徴とする金融商品取引管理システム。  
。

【請求項12】

相場価格の変動する金融商品の取引を行う金融商品取引管理システムにおける金融商品取引管理方法であって、  
金融商品を注文するための注文情報を生成する注文情報生成手順と、  
前記金融商品の約定を管理する約定管理手順とを備え、  
前記注文情報によって形成された、一部又は全部を約定可能な第一注文と、該第一注文  
が約定して保有するポジションを、約定によって決済させる、一部又は全部を約定可能な第二注文とのうちの、前記第一注文のうちの一部のみ、及び／又は、前記第二注文のうちの一部のみが約定の条件を満たし、条件を満たした一部の前記第一注文のみ、及び／又は、条件を満たした一部の前記第二注文のみに対し、前記約定管理手順において約定する処理が行われた場合。

前記注文情報生成手順においては、  
前記約定する処理が行われた一部の前記第一注文に対応する一部の前記第二注文を発注させる処理、及び／又は、前記約定する処理が行われた一部の前記第二注文に対応する一部の前記第一注文を発注させる処理を行うことを特徴とする金融商品取引管理システムにおける金融商品取引管理方法。

【請求項13】

コンピュータを、請求項1乃至10の何れか一つに記載の金融商品取引管理装置又は請求項11の金融商品取引管理システムとして機能させることを特徴とするプログラム。

【手続補正2】

【補正対象書類名】明細書

【補正対象項目名】0006

【補正方法】変更

【補正の内容】

【0006】

かかる課題を解決するため、請求項1に記載の発明は、相場価格の変動する金融商品の取引を行う金融商品取引管理装置であって、金融商品を注文するための注文情報を生成する注文情報生成手段と、前記金融商品の約定を管理する約定管理手段とを備え、前記注文情報によって形成された、一部又は全部を約定可能な第一注文と、該第一注文が約定して保有するポジションを約定によって決済させる、一部又は全部を約定可能な第二注文とのうちの、前記第一注文のうちの一部のみ、及び／又は、前記第二注文のうちの一部のみが

10

20

30

40

50

約定の条件を満たし、条件を満たした一部の前記第一注文のみ、及び／又は、条件を満たした一部の前記第二注文のみに対し、前記約定管理手段によって約定する処理が行われた場合、前記注文情報生成手段は、前記約定する処理が行われた一部の前記第一注文に対応する一部の前記第二注文を発注させる処理、及び／又は、前記約定する処理が行われた一部の前記第二注文に対応する一部の前記第一注文を発注させる処理を行うことを特徴とする。

【手続補正3】

【補正対象書類名】明細書

【補正対象項目名】0016

【補正方法】変更

【補正の内容】

【0016】

請求項11に記載の発明は、相場価格の変動する金融商品の取引を行う金融商品取引管理システムであって、金融商品を注文するための注文情報を生成する注文情報生成手段と、前記金融商品の約定を管理する約定管理手段とを備え、前記注文情報によって形成された、一部又は全部を約定可能な第一注文と、該第一注文が約定して保有するポジションを約定によって決済させる、一部又は全部を約定可能な第二注文とのうちの、前記第一注文のうちの一部のみ、及び／又は、前記第二注文のうちの一部のみが約定の条件を満たし、条件を満たした一部の前記第一注文のみ、及び／又は、条件を満たした一部の前記第二注文のみに対し、前記約定管理手段によって約定する処理が行われた場合、前記注文情報生成手段は、前記約定する処理が行われた一部の前記第一注文に対応する一部の前記第二注文を発注させる処理、及び／又は、前記約定する処理が行われた一部の前記第二注文に対応する一部の前記第一注文を発注させる処理を行うことを特徴とする。

【手続補正4】

【補正対象書類名】明細書

【補正対象項目名】0017

【補正方法】変更

【補正の内容】

【0017】

請求項12に記載の発明は、相場価格の変動する金融商品の取引を行う金融商品取引管理システムにおける金融商品取引管理方法であって、金融商品を注文するための注文情報を生成する注文情報生成手順と、前記金融商品の約定を管理する約定管理手順とを備え、前記注文情報によって形成された、一部又は全部を約定可能な第一注文と、該第一注文が約定して保有するポジションを、約定によって決済させる、一部又は全部を約定可能な第二注文とのうちの、前記第一注文のうちの一部のみ、及び／又は、前記第二注文のうちの一部のみが約定の条件を満たし、条件を満たした一部の前記第一注文のみ、及び／又は、条件を満たした一部の前記第二注文のみに対し、前記約定管理手順において約定する処理が行われた場合、前記注文情報生成手順においては、

前記約定する処理が行われた一部の前記第一注文に対応する一部の前記第二注文を発注させる処理、及び／又は、前記約定する処理が行われた一部の前記第二注文に対応する一部の前記第一注文を発注させる処理を行うことを特徴とする。

10

20

30

40

50