

【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】平成24年6月21日(2012.6.21)

【公表番号】特表2011-520191(P2011-520191A)

【公表日】平成23年7月14日(2011.7.14)

【年通号数】公開・登録公報2011-028

【出願番号】特願2011-507691(P2011-507691)

【国際特許分類】

G 0 6 Q 40/02 (2012.01)

【F I】

G 0 6 F 17/60 2 3 4 A

【手続補正書】

【提出日】平成24年5月1日(2012.5.1)

【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】

【特許請求の範囲】

【請求項 1】

エンティティによって管理されている証券に対してプリンシパル方式レンディング・トランザクションを実行し、前記エンティティの貸出口座から前記エンティティの借入口座に前記証券を貸し出すためのコンピュータにより実施される方法であって、前記エンティティは前記トランザクションにおいてプリンシパルとして機能し、前記方法が、

前記エンティティの貸出口座から借り入れるために利用可能な証券のアベイラビリティを示す証券アベイラビリティ情報を、プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムから電子的に送信するステップと、

借入口座に対する証券の空売り(short)指示を電子的に受信するステップと、

前記空売りした証券のカストディを少なくとも 1 つの貸出口座から、前記少なくとも 1 つの貸出口座の前記エンティティと同一のエンティティの借入口座に移管するために、移転命令をカストディ制御コンピュータ・システムに電子的に送信するステップと、

前記プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムへの前記コストディの移管の記録を電子的に送信するステップと、
を備えている、方法。

【請求項 2】

請求項 1 記載のコンピュータにより実施される方法において、前記空売り指示が、空売りの後に、借入口座による空売りを検出するために取引コンピュータ・システムを監視することにより受信される、方法。

【請求項 3】

請求項 1 記載のコンピュータにより実施される方法において、前記空売り指示が、空売りの前に、借入要求として受信され、前記証券アベイラビリティ情報に基づいて借り入れる証券を特定する、方法。

【請求項 4】

請求項 3 記載のコンピュータにより実施される方法において、前記借入要求は、投資マネージャから前記借入口座に対して受信される、方法。

【請求項 5】

請求項 1 記載のコンピュータにより実施される方法において、証券アベイラビリティ情報を電子的に送信する前記ステップが、

借入のために求められる証券を特定する証券位置特定要求を電子的に受信するステップと、

借入のために求められる証券のアベイラビリティを示す証券位置特定要求応答を電子的に送信するステップと、
を備えている、方法。

【請求項 6】

請求項 5 記載のコンピュータにより実施される方法において、前記証券位置特定要求が、投資マネージャから前記借入口座に対して受信される、方法。

【請求項 7】

請求項 1 記載のコンピュータにより実施される方法において、前記貸出口座および前記借入口座は、共に、前記エンティティの同一のクライアントに属する、方法。

【請求項 8】

請求項 1 記載のコンピュータにより実施される方法において、前記証券アベイラビリティ情報が、プリンシパル方式レンディング・トランザクションに関与しようと試みる貸出口座からの情報に基づいて、前記プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムに格納される、方法。

【請求項 9】

請求項 8 記載のコンピュータにより実施される方法において、プリンシパル方式レンディング・トランザクションに関与しようと試みる貸出口座からの前記情報が、前記エンティティの貸出エージェントから受信される、方法。

【請求項 10】

請求項 1 記載のコンピュータにより実施される方法であって、更に、プリンシパル方式レンディング・トランザクションのために現金担保を得るために、前記借入口座によって保持されている買い持ち(long)証券のブローカに対する貸出トランザクションを開始するステップを備えている、方法。

【請求項 11】

請求項 1 記載のコンピュータにより実施される方法において、前記空売りした証券のカストディを前記少なくとも 1 つの貸出口座から前記借入口座に移管するために、前記移管命令を前記カストディ制御コンピュータ・システムに電子的に送信する前記ステップの結果、前記借入証券の売却の収益が前記借入口座に送信される、方法。

【請求項 12】

請求項 1 記載のコンピュータにより実施される方法において、前記空売りした証券のカストディを前記少なくとも 1 つの貸出口座から前記借入口座に移管するために、前記移管命令を前記カストディ制御コンピュータ・システムに電子的に送信する前記ステップの結果、前記借入証券の売却の収益が前記借入口座に送信され、前記クライアントが、当該クライアントのロング・ポジションを埋めるために前記売却収益を用いて、前記借入口座に対する証券の購入を開始することを可能にする、方法。

【請求項 13】

エンティティによって管理されている証券に対してプリンシパル方式レンディング・トランザクションを実行し、前記エンティティの貸出口座から当該エンティティの借入口座に前記証券を貸し出すためのシステムであって、前記エンティティは前記トランザクションにおいてプリンシパルとして機能し、前記システムが、

前記エンティティの貸出口座から借入に利用可能な前記証券のアベイラビリティを示す証券アベイラビリティ情報を格納するように構成されているコンピュータ・データベースと、

前記コンピュータ・データベースに接続されているプリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムによって実施されるコンピュータ・サーバ・システムであって、前記プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムが借入口座に対する証券の空売り(short)指示を受信するように構成されている、コンピュータ・サーバ・システムと

、

を備えており、

前記プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムが、更に、前記空売りした証券のカストディを少なくとも1つの貸出口座から、この少なくとも1つの貸出口座の前記エンティティと同一のエンティティの前記借入口座に移管するために、移管命令を前記カストディ制御コンピュータ・システムに電子的に送信するように構成されており、前記プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムが、更に、前記カストディの移管の記録を電子的に受信するように構成されている、システム。

【請求項14】

請求項13記載のシステムにおいて、前記空売り指示が、前記空売りの後に、借入口座による空売りを検出するために取引コンピュータ・システムを監視することにより受信される、システム。

【請求項15】

請求項13記載のシステムにおいて、前記空売り指示が、前記空売りの前に、借入要求として受信され、前記証券アベイラビリティ情報に基づいて、借り入れる証券を特定する、システム。

【請求項16】

請求項15記載のシステムにおいて、前記借入要求が、投資マネージャから前記借入口座に対して受信される、システム。

【請求項17】

請求項13記載のシステムにおいて、前記コンピュータ・サーバ・システムによって証券アベイラビリティ情報を電子的に送信する際、

借入のために求められる証券を特定する証券位置特定要求を電子的に受信することと、

借入のために求められる証券のアベイラビリティを示す証券位置特定要求応答を電子的に送信することと、
を備えている、システム。

【請求項18】

請求項17記載のシステムにおいて、前記証券位置特定要求が、投資マネージャから前記借入口座に対して受信される、システム。

【請求項19】

請求項13記載のシステムにおいて、前記貸出口座および前記借入口座が、共に、前記エンティティと同一のクライアントに属する、システム。

【請求項20】

請求項13記載のシステムにおいて、前記証券アベイラビリティ情報が、プリンシパル方式レンディング・トランザクションに参与しようとする貸出口座からの情報に基づいて、前記プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムに格納される、システム。

【請求項21】

請求項20記載のシステムにおいて、プリンシパル方式レンディング・トランザクションに参与しようとする貸出口座からの前記情報が、前記エンティティの貸出エージェントから受信される、システム。

【請求項22】

請求項13記載のシステムにおいて、前記システムが、プリンシパル方式レンディング・トランザクションのために現金担保を得るために、前記借入口座によって保持されている買い持ち(long)証券のブローカに対する貸出トランザクションを開始する、システム。

【請求項23】

請求項13記載のシステムにおいて、前記空売りした証券のカストディを前記少なくとも1つの貸出口座から前記借入口座に移管するために、前記システムが前記移管命令を前記カストディ制御コンピュータ・システムに電子的に送信するときに、前記借入証券の売却の収益が前記借入口座に送信される、システム。

【請求項24】

請求項 2 3 記載のシステムにおいて、前記空売りした証券のカストディを前記少なくとも 1 つの貸出口座から前記借入口座に移管するために、前記システムが前記移管命令を前記カストディ制御コンピュータ・システムに電子的に送信するときに、前記借入証券の売却の収益が前記借入口座に送信され、前記クライアントが、当該クライアントのロング・ポジションを埋めるために前記売却収益を用いて、前記借入口座に対する証券の購入を開始することを可能にする、システム。

【請求項 2 5】

エンティティによって管理されている証券に対してプリンシパル方式レンディング・トランザクションを実行し、前記エンティティの貸出口座から前記エンティティの借入口座に前記証券を貸し出すためのコンピュータにより実施される方法であって、前記エンティティが前記トランザクションにおいてプリンシパルとして機能し、前記方法が、

前記エンティティの貸出口座から借り入れるために利用可能な証券のアベイラビリティを示す証券アベイラビリティ情報を、プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムから電子的に送信することを可能にするステップと、

借入口座に対する証券の空売り指示を電子的に受信することを可能にするステップと、

前記空売りした証券のカストディを少なくとも 1 つの貸出口座から、前記少なくとも 1 つの貸出口座の前記エンティティと同一のエンティティの借入口座に移管するために、移管命令をカストディ制御コンピュータ・システムに電子的に送信することを可能にするステップと、

前記プリンシパル方式レンディング・コンピュータ・システムへの前記コストディ移管の記録を電子的に送信することを可能にするステップと、
を備えている、方法。