

ETF 及び ETN にかかる制限値幅の拡大運用の一部見直しについて

2021年7月2日

東京証券取引所 株式部

1. ETF 及び ETN に係る制限値幅の拡大要件等の見直し

現在、当取引所においては、原則として、重複上場外国銘柄を除くすべての上場株券等において、2営業日連続で次のいずれかに該当した場合には、翌営業日から制限値幅の拡大を実施することとしています。

- (1) ストップ高(安)となり、かつ、ストップ配分も行われず売買高が0株
- (2) 売買高が0株のまま午後立会終了を迎え、午後立会終了時に限りストップ高(安)で売買が成立し、かつ、ストップ高(安)に買(売)呼値の残数あり

このうち、重複上場外国銘柄を除く ETF 及び ETN(以下単に「ETF 及び ETN」といいます。)については、ストップ高(安)の値段で立会を終了する場合、以下のとおり翌営業日から制限値幅の拡大を行うこととします。ETF 及び ETN 以外の商品については、現行の運用を継続します。

<ETF 及び ETN に係る制限値幅の拡大運用の見直し内容>

	現行	見直し後
拡大要件	原則として、 <u>2営業日連続</u> で次のいずれかに該当した場合、 <u>翌営業日(3営業日目)</u> から制限値幅を4倍に拡大する。 (1) ストップ高(安)となり、かつ、ストップ配分も行われず売買高が0株 (2) 売買高が0株のまま午後立会終了を迎え、午後立会終了時に限りストップ高(安)で売買が成立し、かつ、ストップ高(安)に買(売)呼値の残数あり	原則として、ストップ高(安)の値段で立会を終了した場合、 <u>翌営業日(2営業日目)</u> から、制限値幅を4倍に拡大する。
拡大方向 拡大幅	ストップ高の場合は制限値幅の上限を、ストップ安の場合には制限値幅の下限をそれぞれ通常の制限値幅の4倍に拡大する。	変更なし

解除要件	拡大された日以降、拡大後のストップ高(安)の値段以外の値段で売買が成立した場合、翌営業日から解除する。	拡大された日以降、拡大後のストップ高(安)の値段以外の値段で売買が成立しかつ立会を終了した場合、翌営業日から解除する。
------	---	---

2. 公表について

値幅の拡大を行う場合は、従来どおり、見直し後の拡大要件に該当することとなった日の15時15分頃を目途に都度ご通知します。

なお、毎営業日15時30分頃を目途に行っている拡大要件の(1)又は(2)に該当した銘柄(ストップ配分等該当銘柄)一覧ファイルの当社ウェブサイト上¹での公表にあたっては、運用の見直し日以降、ETF及びETNについては別ファイルにて公表することとします。

3. 実施時期

2021年11月29日(月)以降、見直し後の拡大要件に該当した銘柄について適用します。

以上

¹ <https://www.jpx.co.jp/equities/trading/domestic/06.html> (日本語ページ)
<https://www.jpx.co.jp/english/equities/trading/domestic/06.html> (英語ページ)