(12) 特許協力条約に基づいて公開された国際出願

(19) 世界知的所有権機関
国際事務局

(43) 国際公開日
2012 年 2 月 23 日(23.02.2012)

PCT

(10) 国際公開番号
WO 2012/023304 A1

(51) 国際特許分類:
G06Q 40/00 (2006.01)

(21) 国際出願番号: PCT/JP2011/057392

(22) 国際出願日: 2011 年 3 月 25 日(25.03.2011)

(25) 国際出願の言語: 日本語

(26) 国際公開の言語: 日本語

(30) 優先権データ:
特願 2010-185537 2010 年 8 月 20 日(20.08.2010) JP

(71) 出願人 (米国を除く全ての指定国について): 株式会社 東芝 (KABUSHIKI KAISHA TOSHIBA) [JP/JP]; 〒1058001 東京都港区芝浦一丁目１番１号 Tokyo (JP). 東芝ソリューション株式会社 (TOSHIBA SOLUTIONS CORPORATION) [JP/JP]; 〒1056691 東京都港区芝浦一丁目１番１号 Tokyo (JP).

(72) 発明者; および

(75) 発明者/出願人 (米国についてのみ): 茅沼 英司 (KAYANUMA, Eiji) [JP/JP]. 新井 浩 (ARAI, Hiroshi) [JP/JP]. 畑田 健太郎 (HATADA, Kentaro) [JP/JP]. 宇佐美 宣由 (USAMI, Nobuyoshi) [JP/JP]. 栗原 知弘 (KURIHARA, Tomohiro) [JP/JP]. 佐藤 晴郎 (SATOU, Haruo) [JP/JP].

(74) 代理人: 蔵田 昌俊, 外 (KURATA, Masatoshi et al.); 〒1050001 東京都港区虎ノ門１丁目１２番９号 鈴榮特許綜合事務所内 Tokyo (JP).

(81) 指定国 (表示のない限り、全ての種類の国内保護が可能): AE, AG, AL, AM, AO, AT, AU, AZ, BA, BB, BG, BH, BR, BW, BY, BZ, CA, CH, CL, CN, CO, CR, CU, CZ, DE, DK, DM, DO, DZ, EC, EE, EG, ES, FI, GB, GD, GE, GH, GM, GT, HN, HR, HU, ID, IL, IN, IS, KE, KG, KM, KN, KP, KR, KZ, LA, LC, LK, LR, LS, LT, LU, LY, MA, MD, ME, MG, MK, MN, MW, MX, MY, MZ, NA, NG, NI, NO, NZ, OM, PE, PG, PH, PL, PT, RO, RS, RU, SC, SD, SE, SG, SK, SL, SM, ST, SV, SY, TH, TJ, TM, TN, TR, TT, TZ, UA, UG, US, UZ, VC, VN, ZA, ZM, ZW.

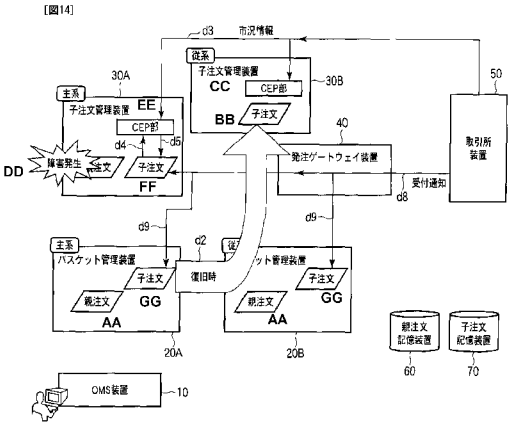
(84) 指定国 (表示のない限り、全ての種類の広域保護が可能): ARIPO (BW, GH, GM, KE, LR, LS, MW, MZ, NA, SD, SL, SZ, TZ, UG, ZM, ZW), ユーラシア (AM, AZ, BY, KG, KZ, MD, RU, TJ, TM), ヨーロッパ (AL, AT, BE, BG, CH, CY, CZ, DE, DK, EE, ES, FI, FR, GB, GR, HR, HU, IE, IS, IT, LT, LU, LV, MC, MK, MT, NL, NO, PL, PT, RO, RS, SE, SI, SK, SM, TR), OAPI (BF, BJ, CF, CG, CI, CM, GA, GN, GQ, GW, ML, MR, NE, SN, TD, TG).

[続葉有]

(54) **Title**: SECURITIES TRANSACTION SYSTEM AND DEVICE

(54) 発明の名称 : 証券売買システム及び装置

[図14]



10 OMS DEVICE
20A MAIN SYSTEM BASKET MANAGEMENT DEVICE
20B SUB SYSTEM BASKET MANAGEMENT DEVICE
30A MAIN SYSTEM CHILD ORDER MANAGEMENT DEVICE
30B SUB SYSTEM CHILD ORDER MANAGEMENT DEVICE
40 ORDER GATEWAY DEVICE
50 EXCHANGE DEVICE
60 PARENT ORDER MEMORY DEVICE
70 CHILD ORDER MEMORY DEVICE

d2 DURING RESTRATION
d3 MARKET INFORMATION
d8 RECEIPT NOTICE
AA PARENT ORDER
BB CHILD ORDER
CC CEP UNIT
DD OCCURRENCE OF FAILURE
EE CEP UNIT
FF CHILD ORDER
GG CHILD ORDER

(57) **Abstract**: Disclosed is a high availability system for securities transaction. Each of a plurality of order sharing devices (master/slave basket management units (20A/20B)) shares and stores a parent order (for example a VWAP strategy) from an OMS device (10) and stores a child order which is divided from the parent order and formatted (the price is blanked). A main system ordering device (main system child order management device, (30A)) stores the parent order and child order, and sends a trading order (price included) to an exchange device (50) after analyzing market conditions. If a failure is detected in the main system ordering device (30A), a main system order sharing device (20A) sends a pending child order and a corresponding parent order to a sub system ordering device (30B) for the sake of restoration (d2), and switches the ordering device (30B) into the main system.

(57) 要約: 証券売買のための高可用性システム。複数の注文共有装置（主／従 バスケット管理装置, 20A/20B）は、それぞれ、OMS 装置(10)からの親注文（e.g. VWAP 戦略）を共有して記憶し、また、親注文から分割されフォーマットされた（価格は空白の）子注文を記憶する。主系の発注装置（主 子注文管理装置, 30A）は、それらの親注文と子注文とを記憶し、市況を分析して取引所装置(50)に（価格が入った）売買注文を送る。もし、主系の発注装置(30A)で障害が検出されたら、主系の注文共有装置(20A)は、復旧のため、ペンディングしている子注文及び対応する親注文を従系の発注装置(30B)に送り(d2)、この発注装置(30B)を主系へと切り替える。

WO 2012/023304 A1