

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

平成 26 年 4 月 1 日より、消費税率が 5% から 8% へ変更となることに伴い、現在、ドットコムメディア社と提携してお客様に提供しております指数先物取引サービスにおいて、平成 26 年 4 月 1 日の約定分のお取引から、変更後の税率が適用されます。

つきましては、契約に係る書面中の手数料の記載について、消費税分の変更を行わせて頂きました。

また、平成 26 年 3 月 24 日に実施された旧東京証券取引所及び旧大阪証券取引所のデリバティブ統合に伴い、「大阪証券取引所」から「大阪取引所」へ名称の修正を行っております。

上記の理由により、契約書面の変更を行っております。以下に書面を記載しておりますので、次の修正書面をご確認のうえ、ご同意いただいたうえで取引を行っていただきますよう、よろしくお願い申し上げます。

また、他に未読の書面等がございましたら、併せてご確認くださいませよう、よろしくお願い申し上げます。

- ・先物・オプション取引に関する契約締結前交付書面（平成 26 年 4 月 1 日）
- ・先物・オプション取引ルール（平成 26 年 4 月 1 日）

フィリップ証券株式会社

《書面一覧》

- ・オンライントレード取引約款（平成 24 年 12 月 1 日）
- ・先物・オプション取引規定（平成 24 年 12 月 1 日）
- ・先物・オプションに関する確認書 兼 同意書 兼 申請書（平成 25 年 7 月 16 日）
- ・先物・オプション取引口座設定約諾書（平成 25 年 7 月 16 日）
- ・先物・オプション取引に関する契約締結前交付書面（平成 26 年 4 月 1 日）
- ・先物・オプション取引ルール（平成 26 年 4 月 1 日）

# オンライントレード取引約款

## 第1章 総則

### 第1条 (約款の趣旨)

この約款は、お客様とフィリップ証券株式会社(以下、「当社」といいます)との間におけるインターネットまたは電話等を利用した商品に関する取引、およびその商品に付随して提供する当社のサービス等(以下、「本サービス」といいます)の内容について権利義務関係に関する事項を明確にすることを目的とするものです。

### 第2条 (本サービスの内容)

1. お客様は本サービスを利用し、当社が定める金融商品、商品先物取引等の注文等を行うことができます。
2. お客様は本サービスを利用し、取引の他、取引に付随して提供するサービスを利用することができます。
3. 本サービスの詳細は、別途定めるものとします。

### 第3条 (本サービスの申込方法等)

1. お申込み方法は、お客様がインターネットあるいは当社所定の申込書によりお手続きをし、当社所定の本人確認書類を提出いただくものとします。当社がこれを承諾した場合に限り、本サービスの契約が締結されます。なお、承諾しない場合の理由開示は行いません。
2. 前項の定めにかかわらず、取引に付随して提供するサービスの申込みについては、本人確認書類の提出を不要とする場合があります。この場合は、それぞれのサービスの規定等に定めるものとします。

### 第4条 (本サービスの申込条件)

1. 当社は、日本証券業協会の「定款の施行に関する規則」に定める反社会的勢力(以下、単に「反社会的勢力」といいます)のお申込みは受付いたしません。お申込に際しては、次に掲げる事項を確約するものとします。
  - (1) 反社会的勢力に該当せず、かつ将来にわたっても該当しないこと
  - (2) 自ら又は第三者を利用して、暴力的な要求、法的な責任を超えた不当な要求行為、取引に関して脅迫的な言動をし又は暴力を用いる行為、風説を流布し偽計を用い又は威力を用いて当社の信用を毀損し又は当社の業務を妨害する行為等を行わないこと
2. お客様は、以下の条件をすべて満たす場合に、本サービスのお申込みができるものとします。
  - (1) お客様が個人にあつては、国内に居住されていること
  - (2) お客様が個人にあつては、年齢が20歳以上であること
  - (3) お客様が個人にあつては、年齢が75歳以下であること
  - (4) インターネットを利用できる環境にあり、パソコンの操作に支障がないこと
  - (5) 会話に支障なく日本語でのコミュニケーションが可能なこと
  - (6) 次のいずれにも該当しないこと
    1. 未成年、成年被後見人、被補佐人、被補助人、精神障害、知的障害、認知障害に該当する方
    2. 生活保護法による保護を受けている世帯に属する方
    3. 元本欠損又は元本を上回る損失が生ずるおそれのある取引をしたくない方

### 第5条 (届出事項)

1. お客様は第3条のお申込み時に、お客様本人の真正の氏名又は名称、住所、法人の場合における代表者等を

当社指定の手続きにより届け出るものとします。仮名、借名、気付け住所は認められません。

2. お客様は当社に正確な情報の届出を行うこととし、万一、届け出に相違する事項がある場合は、当社は、お客様に通知することなく、取引の制限または口座の解約を行うことができるものとします。
3. 当社は、「犯罪による収益移転防止に関する法律」に基づき、第1項にかかる事項について、お客様の本人確認を行います。その際に、お客様に連絡する場合がありますので、お客様はこれに応じるものとします。

#### 第6条（届出事項の変更）

1. お客様は、口座申込時に申告した事項について変更がある場合は、当社所定の手続きに従って、直ちに届け出るものとします。
2. お客様は前項のお届けの際に、当社所定の手続きに応じて本人確認書類をご提出いただきます。
3. 当社はお客様からの変更の届出がない場合、また、その届出の途中で手続きが完了していない場合に、お客様の取引を制限又は停止させていただくことがあります。
4. 前項の取引の制限又は停止によって生じたお客様の損害については、当社はその責を負わないものとします。

#### 第7条（本人認証）

1. 当社は、本サービスのご利用に際して本人認証を行います。本人認証は、ログインID並びにログインパスワードの一致により行います。
2. お客様は、当社が前項の方法により本人認証が行えた場合にのみ本サービスを利用することができます。これらの本人認証が行えない場合は、当社は、お客様の本サービスのご利用をお断りします。なお、認証コードを失念又は紛失された場合は、速やかに当社までお申し出ください。

#### 第8条（自己責任の原則）

お客様は、本サービスのリスク、特殊性、本約款およびその他規定等の内容を十分に理解し、自らの責任と判断において、本サービスを利用して取引を行うものとします。

#### 第9条（法令等の遵守）

お客様及び当社は本サービスの利用にあたり、本約款およびその他の規定等のほか、関係法令および監督機関の諸規則等を遵守するものとします。

## 第2章 注文の受託等

#### 第10条（利用期間等）

お客様が本サービスを利用できる期間及び時間は、当社が定めるものとします。

#### 第11条（取引の種類）

お客様が本サービスにおいて取引できる商品および取引の種類は、当社が別途定めるものとします。

#### 第12条（取扱銘柄）

1. お客様が本サービスで取引できる銘柄は、当社が別途定めるものとします。
2. 前項で定めた銘柄のうち、取引所等が規制している等の理由により、当該定めは予告なく変更される場合があります。

### 第13条（取扱数量の範囲）

1. 当社が返済注文を受付する数量は、お客様がその時点で保有しているポジションの範囲内とします。
2. 当社が新規注文を受付する数量は、当社が別途定める数量の範囲内とします。

### 第14条（有効期限）

お客様が本サービスを利用して取引する注文の有効期限は、当社が別途定める期限の範囲内とします。

### 第15条（取引回数の範囲）

お客様が本サービスを利用して同一営業日内に同一銘柄に係る取引注文を行うことができる範囲は、当社が別途定める回数の範囲内とします。

### 第16条（注文の受託）

1. お客様が本サービスを利用して行う取引は、注文内容入力後、その入力内容を当社が受信し、受け付けた時点をもって当社の受託とします。
2. 当社は、お客様の取引注文の内容が次に掲げる事項のいずれかに該当する場合は、当該取引注文の受託を行いません。なお、取引注文の受託をしないことにより生じるお客様の損害については、当社はその責を負わないものとします。
  - (1) お客様の取引注文が法令諸規則及び各約款等に定める事項のいずれかに反するとき
  - (2) お客様の取引注文が各商品で別途定める値幅制限を超えるとき
  - (3) お客様の取引注文が各商品で別途定める売買規制等に抵触するとき
  - (4) お客様の取引注文が公正な価格形成に弊害をもたらすものであると当社が判断するとき
  - (5) その他、当社が取引の健全性等に照らし不相当と判断するとき

### 第17条（注文の取消、変更）

お客様が本サービスを利用して行った取引注文の取消又は変更は、当該取引注文が未約定でかつ当社が定める時間、条件の範囲内に限り、当社が定める方法により行えるものとします。

### 第18条（執行）

お客様が本サービスを利用して行う取引は、法令諸規則及び各約款等の定めに従い、注文内容の確認後、速やかに執行するものとします。但し、受託した取引の注文において、次に掲げる事項のいずれかに該当する場合は、お客様に通知することなく、その執行をしません。なお、執行をしないことにより生じるお客様の損害については、当社はその責を負わないものとします。

- (1) お客様の取引注文が法令諸規則及び各約款等に定める事項のいずれかに反するとき
- (2) お客様の取引注文が各商品で別途定める値幅制限を超えるとき
- (3) お客様の取引注文が各商品で別途定める売買規制等に抵触するとき
- (4) お客様の取引注文が公正な価格形成に弊害をもたらすものであると当社が判断するとき
- (5) その他、当社が取引の健全性等に照らし不相当と判断するとき

### 第19条（注文の照会）

お客様は、本サービスを利用して行う取引の内容および約定内容の照会は、本サービスにより照会することができます。但し、当社が別途定めた場合はこの限りではありません。

## 第20条（取引内容等の確認）

お客様が本サービスを利用して行う取引の内容について、お客様と当社との間で疑義が生じたときは、お客様の本サービスを利用するに際して入力された当社の記録内容をもって処理するものとします。

## 第21条（不足金の発生）

1. お客様の本サービスの利用に際し、不足金が生じた場合には、当社所定の期限までに当該不足金額を入金するものとします。
2. お客様が前項の期限までに不足金をご入金いただけない場合、当社は当社の任意によりお客様の有価証券、ポジション等を処分し、口座にお預かりしている現金を当該不足金に充当することができるものとし、更に不足がある場合には、お客様に当該不足金額の支払を請求することができるものとします。
3. 不足金が生じている場合は、当社は、本サービスの利用を制限できるものとします。
4. 当社は、前項の取引の制限によってお客様に生じる損害について、その責を負わないものとします。

## 第22条（取引手数料）

1. 当社は、お客様の取引に関する手数料として、当社が別途定める手数料およびその消費税をお客様より申し受けます。
2. 前項の当社が定める手数料は、経済情勢の変動、その他事情変化により、これを改定できるものとします。

# 第3章 金銭の受渡

## 第23条（入金）

1. お客様が当社にご入金いただく場合は、ご本人名義により、当社が指定する銀行口座への振込みに限ることとします。
2. 当社は銀行振込みによる入金を確認した後に、お客様の口座へ入金を反映するものとします。
3. お客様がご入金する場合に要する振込み手数料はお客様にご負担いただくものとします。但し、当社の定めるところにより当該手数料の一部又は全部を当社が負担する場合があります。

## 第24条（出金）

1. お客様が当社からご出金いただく場合は、お客様があらかじめ指定した指定預金口座に振込みを行うものとします。
2. 指定預金口座は、当社の口座名義と同一としていただきます。
3. 当社がお申込みを受け付け、登録した指定預金口座の内容に相違があるときは、速やかに当社へお申し出ください。
4. 指定預金口座の変更は、当社所定の手続きによって届け出るものとします。
5. 出金手続きにかかわる振込みに要する手数料は、お客様にご負担いただくものとします。但し、当社の定めるところにより当該手数料の一部又は全部を当社が負担する場合があります。

## 第25条（金銭の受渡内容の確認）

金銭の受渡について、お客様と当社との間で疑義が生じたときは、お客様の本サービスを利用した際に入力された当社の記録内容をもって処理するものとします。

## 第4章 報告

### 第26条（契約締結時交付書面（取引報告書））

1. お客様の取引注文が成立したときには、遅滞なく、契約締結時交付書面をお客様に交付いたします。（電子情報処理組織）を使用する方法による交付を含みます。
2. 同報告書の内容に関する事項で不審な点があるときは、速やかに当社にお申し出ください。

### 第27条（取引残高報告書）

1. 当社は、3 ヶ月に1回以上、期間内のお取引内容及びお取引後の残高を記載した取引残高報告書をお客様に交付いたします。期間内にお取引がない場合は、1年に1回以上、取引残高報告書をお客様に交付いたします。（電子情報処理組織）を使用する方法による交付を含みます。
2. 取引残高報告書を交付した後、15日以内にご連絡がなかったときは、当社はその記載事項すべてについてご承認いただいたものとさせていただきます。取引残高報告書を受領した場合は、速やかにその内容をご確認ください。
3. 同報告書の内容に関する事項で不審な点があるときは、速やかに当社にお申し出ください。

## 第5章 情報サービス

### 第28条（情報利用）

1. お客様は本サービスにおいて、当社が定める投資に関する情報（第三者から提供を受け、当社が再配信するものを含みます。以下、「情報サービス」といいます。）を利用できるものとします。
2. 当社は当社が定める情報サービスを有料で提供する場合があります。かかる情報の利用を希望されるお客様は、有料情報の種類、内容に応じて当社が別途定める方法により、お申込みするものとします。

### 第29条（情報利用の制限）

1. お客様は、本サービスにより提供された情報をお客様の行う取引の資料にのみ利用するものとし、次にかかげることを行わないものとします。
  - (1) 本サービスにより提供された情報（これらを複製したものを含む。以下同じ。）を第三者に提供すること。
  - (2) 本サービスにより提供された情報を、営業に利用することのほか、第三者へ提供する目的で加工又は再利用（再配信を含む。）すること。
  - (3) お客様のログインID及びパスワード等を第三者に譲渡し又は第三者の利用に供すること。また、本サービスにより取得した情報を第三者に漏洩し、又は他の者と共同して利用すること。
2. 前項に反するものと当社又は金融商品取引所等が判断した場合、当社は本サービスの利用を制限又は停止できるものとします。なお、本サービスの利用制限又は停止によりお客様に費用又は損害等が発生した場合、当該費用又は損害等はすべてお客様の負担とし、お客様は当社および金融商品取引所等に対し請求は行わないものとします。

### 第30条（情報利用料）

1. 有料情報の利用にかかる情報利用料は当社が別途定める金額とし、お客様は、当該情報利用料およびその消費税の合計額を当社が別途定める方法で当社へ支払うものとする。
2. 前項の当社が定める手数料は、経済情勢の変動、その他事情変化により、これを改定できるものとします。
3. 一旦お支払いいただいた情報利用料は、中途解約ならびに第 28 条に定める利用の制限を行った場合を含め、いかなる理由でも返却いたしません。

## 第 6 章 解約・利用制限・免責等

### 第31条（解約）

次にかかげるいずれかに該当する場合には、本サービス提供に係る契約を解約することができるものとします。

- (1) お客様が当社所定の方法により、解約を申し出た場合
- (2) お客様が法令等、本約款およびその他関係規定等に違反した場合
- (3) お客様が本約款およびその他関係規定等に同意されないとき
- (4) 当社が本サービスの解約を申し出た場合
- (5) 当社の判断により、当社すべてのお客様に対し、本サービスの提供を終了した場合
- (6) お客様が本サービスの申込時にした確約に関して虚偽の申告をしたことが認められ、当社が解約を申し出た場合
- (7) お客様が当社に対する届出事項について虚偽の届出を行っていたことが判明した場合
- (8) お客様が本サービスの口座開設申込受付基準に反することが判明した場合
- (9) お客様又はお客様の代理人が暴力団、暴力団員、暴力団関係企業、総会屋、社会的運動標榜ゴロ、特殊知能暴力団またはこれらに準ずる者等反社会的勢力であると判明し、当社が解約を申し出た場合
- (10) お客様が当社との取引に関して、脅迫的な言動もしくは暴力を用いた場合、法的責任を超えた不当な要求を行った場合、風説の流布もしくは偽計・威力により当社の信用を毀損もしくは当社の業務を妨害した場合、またはこれらに類するやむを得ない事由により当社がお客様に解約を申し出た場合
- (11) 本サービスの装置上、およびシステム上の脆弱性を利用し、端末機器、接続回線またはプログラムの不正な操作または改変など、当社が予め想定しえない操作、もしくは当社が認めていないシステムを利用した売買が行われていると認められる場合、またはその疑いが濃厚であると認められる場合。または、当社のシステムの意図から外れた方法による過大なアクセスにより、当社システムおよび他のお客様に影響を及ぼすと当社が判断した場合
- (12) お客様の口座に残高がなくなった後、相当期間が経過した場合
- (13) その他、合理的な事由により当社が解約を申し出た場合

### 第32条（利用制限）

お客様が、前条の解約事由に該当もしくはその疑いがある場合、当社は取引の制限、もしくは停止を行うことができるものとします。

### 第33条（免責事項）

1. 当社および投資情報等の発信元は、次に掲げる事項により生じるお客様の損害について、その責を負わない

ものとし、但し、当社に故意又は重大な過失がある場合はこの限りではありません。

- (1) お客様自身が入力したか否かを問わず、当社がユーザーID等の一致を確認した上で行われた取引に関する損害。
- (2) お客様の認証コード等が漏えいし、盗用(通信回線及びシステム機器を介したものを含みます。)された場合に生じた損害。但し、「通信回線・システム機器」とは、お客様、プロバイダ、当社、又は金融商品取引所(私設取引システム等を含む)のそれぞれのハードウェア、ソフトウェア、又はそれぞれを結ぶ通信回線のすべてを含むものとします(以下、本条において同じ。)
- (3) コンピューターウイルスや第三者による妨害、侵入、情報改変、業務の遅延等により、本サービスで提供する約定結果、取引情報及びその他の情報伝達遅延、誤謬又は欠陥が生じた場合に生じた損害
- (4) 本サービスにおける通信速度の低下又は通信回線の混雑を理由として、取引注文が受託されなかった場合に生じた損害
- (5) 通信回線・システム機器の瑕疵若しくは障害又は停電により、当社が正常に受け付けた取引注文が執行されない若しくは誤って執行された場合、又は発注されない若しくは誤って発注された場合に生じた損害
- (6) 通信回線・システム機器の瑕疵若しくは障害又は停電により、約定内容が本サービスにおいて表示されない場合、遅れて表示された場合又は誤って表示された場合に生じた損害
- (7) 天災地変、政変、ストライキ、外貨事情の急変、外国為替市場の閉鎖等、不可抗力と認められる事由により、取引注文の執行、金銭又は有価証券の受渡、返還又は寄託その他の事務手続き等が遅延し、又は不能になった場合に生じた損害
- (8) 本約款およびその他規定等の定めに応じて、当社がお客様の取引を制限もしくは停止したことにより生じた損害
- (9) 所定の手続きの不備によりお預りした金銭を返還しなかったことにより生じた損害
- (10) 金銭の入出金に際して投資機会を逸したことに関する損害
- (11) お客様が当社との契約、その他の契約事項に反した取引を行ったことにより生じた損害
- (12) お客様が本サービスの内容又はその利用方法について誤解し、又は理解不足であったことにより生じた損害
- (13) 本サービス提供に係る契約の解約に伴って生じた損害
- (14) その他、当社の責めに帰すことができない事由により、お客様が被った損害

## 第7章 雑則

### 第34条 (システム障害)

当社は、システム障害又は通信回線の混雑等のためにインターネットより本サービスを利用できない場合は、電話により取引注文を受託する場合があります。

### 第35条 (通知の効力)

お客様が当社に届け出た氏名、名称、住所、電話番号又は電子メールアドレス宛てに、当社からの諸通知が、転居、不在、その他当社の責めに帰せられない事由により延着し、又は到達しなかった場合、通常到達すべきときに到達したものとみなして扱うものとします。

### 第36条 (約款の変更)



1. この約款は、法令の変更又は監督官庁の指示、その他変更の必要が生じたときに変更を行うことがあります。
2. 変更の内容がお客様の従来の権利を制限するもしくはお客様に新たな義務を課すものである場合は、その旨を通知します。
3. お客様は本約款の変更に同意しない場合は、前項に基づく通知の受領後 15 日以内に当社に申し出るものとします。係る申し出がない場合は、本規定の変更に同意したものとみなします。
4. 前3項に係らず、第2項に基づく通知の受領後にお客様が新規のお取引を開始された場合は、本約款の変更に同意したものとみなします。
5. 前2項の通知は、変更の内容が軽微であると判断される場合は、当社ホームページ上の掲示による方法に代えることができるものとします。

#### 第37条（本約款の適用）

1. 本約款は、当社が指定する各商品サービスについて適用するものとします。但し、指定した各商品サービスについての規定と本約款が重複している場合は、各商品サービスの規定が優先されるものとします。
2. 前項の規定に定めのない事項は、本約款の各条項が準用されるものとします。

#### 第38条（規定外事項）

本約款に定めのない事項は、その他規定等により定めるものとします。

#### 第39条（合意管轄）

お客様と当社との間の本約款に関する訴訟については、当社本店の所在地を管轄する裁判所のうちから、当社が管轄裁判所を指定できるものとします。

以上

（平成 24 年 12 月 1 日）

## 先物・オプション取引規定

#### 第40条（約款の趣旨）

1. この規定（以下、「本規定」といいます）は、お客様とフィリップ証券株式会社（以下、「当社」といいます）との間におけるインターネット等を利用したオンライントレード取引サービスのうち、指数先物取引及び指数オプション取引（以下、「先物・オプション取引」といいます）に関するサービス（以下、「本サービス」といいます）を利用するにあたっての基本的事項に関する取り決めを定めた規定です。
2. 本規定に特段の定めのない事項は、「オンライントレード取引約款」の規定を準用するものとします。
3. お客様は本規定の他、「先物・オプション取引口座設定約諾書」、その他当社の関連規定等、および関係法令諸規則を遵守するものとします。

#### 第41条（本サービスの申込方法）

1. お客様は、以下の条件すべてを満たす場合に、本サービスのお申込みを行うことができ、当社で本サービスの口座を開設することができます。
  - (1) 「オンライントレード取引約款」第4条第1項および第2項に規定する申込基準を満たすこと。

- (2) 先物・オプション取引制度、先物・オプションにかかわるリスク、当社の「オンライントレード取引約款」、「先物・オプション口座設定約諾書」、「先物・オプション取引ルール」、および本規定等について熟読し、十分な理解を有し、その内容を承諾していること。
  - (3) 「先物・オプション口座設定約諾書」第3条第2項及び「先物・オプション取引に関する確認書 兼 同意書」に記載されている差換預託が行われることに同意していること。
  - (4) 金融資産において、概ね 100 万円以上有していること。
  - (5) 半年以上の証拠金取引もしくは保証金取引などのいわゆるレバレッジ商品の取引経験を有すること。
  - (6) 電話および電子メールにより、常時、連絡がとれること
2. 当社は、前項の条件を満たす場合に限り、先物・オプション取引口座開設の申込を受け付けるものとし、当社の口座開設基準に基づき、口座開設の可否を審査するものとします。
  3. 当社は、前項の審査の結果、当社が先物・オプション取引口座開設を承諾した場合に限り、お客様は当社の先物・オプション取引口座の開設ができるものとします。
  4. 第2項の審査の結果、当社が先物・オプション取引の口座開設をお断りする場合における理由の開示は一切行わないものとします。

#### 第42条（取引の種類）

本サービスで提供する先物・オプション取引の種類及び商品は、当社が定めるものとします。

#### 第43条（取引数量）

1. お客様が行うことのできる先物・オプション取引において保有できる建玉の上限数量は、当社が別途定めるものとします。
2. お客様が行うことのできる先物・オプション取引の1回あたりの注文数量の上限数量は、当社が別途定めるものとします。

#### 第44条（取引時間）

1. お客様が行うことのできる先物・オプションの取引は、当社が定める取扱時間内で行えるものとします。
2. お客様は、金融商品取引所における先物・オプション取引の立会時間内であっても、当社の取扱い時間外となったことにより、先物・オプションの取引ができない場合があることをあらかじめ承諾するものとします。

#### 第45条（証拠金の預託）

1. お客様は、先物・オプション取引の新規注文を行うにあたり、金融商品取引所が定める証拠金所要額等に準じて、当社が別途定める方法により算出した証拠金額以上の証拠金を、あらかじめ当社に差し入れるものとします。
2. 前項の証拠金は、現金により差し入れるものとし、代用有価証券による差し入れには応じないものとします。
3. 第1項の差し入れ方法は、当社が別途定めるものとします。

#### 第46条（証拠金の保管）

お客様が当社に差し入れた証拠金は、金融商品取引所の定めに従い金融商品取引所に預託し、または、関係法令等に従い、当社が当社の資産と分別して保管いたします。

#### 第47条（証拠金の引出）

1. 証拠金の引出可能額は、当社が定める金額の範囲といたします。
2. 証拠金の引出方法は、当社が別途定めるものとします。

#### 第48条（当社受入証拠金）

当社における受入証拠金は、金融商品取引所が定める受入証拠金の計算方法に準じて、当社が別途定める方法により算出するものとします。なお、先物取引における計算上の利益の払出しはできないものとします。

#### 第49条（当社証拠金所要額）

当社における証拠金所要額は、金融商品取引所が定める証拠金所要額の計算方法に準じて、当社が別途定める方法により算出するものとします。

#### 第50条（追加証拠金の預託）

1. 当社は、毎取引日の取引終了後に、先物・オプション取引にかかわる建玉、証拠金を値洗いし、お客様の当社受入証拠金の額、当社証拠金所要額および最低証拠金所要額を算出ものとします。
2. 前項の計算の結果、お客様の当社受入証拠金が、最低証拠金所要額を下回った場合は、その差額以上の追加証拠金を預託するものとします。
3. 前項の追加証拠金の期限は、当該追加証拠金が発生した翌営業日正午とします。
4. 前項の期限までに追加証拠金の必要額以上の証拠金の預託を当社が確認できない場合は、当社はお客様に通知することなく、当社の任意ですべての建玉を処分することができるものとします。

#### 第51条（先物・オプション取引等に伴う不足金）

1. お客様は、先物・オプション取引等に伴い、現金支払予定額が、お客様が差し入れている金銭の額を上回った場合は、その差額（以下、「不足金」という）について、入金するものとします。
2. お客様は、前項に定める不足金を解消するため、受渡日までに入金をしなければならないものとします。

#### 第52条（特別清算指数による清算）

1. 先物取引において、最終取引日までに反対売買を行わなかった建玉は、最終取引日の翌営業日に取引所において算出される特別清算指数(SQ)によって決済を行うものとします。
2. オプション取引において、最終取引日までに決済されなかった買建玉は、最終取引日の翌営業日に取引所において算出される特別清算指数(SQ)によって、自動権利行使処理を行います。自動権利行使処理は、本質的価値を有するものについて行われ、本質的価値を有しないものは、権利消滅とします。また、本質的価値を有する場合にあっても、取引手数料を勘案した結果、お客様に現金支払いが生じる場合は、権利消滅として取扱います。なお、権利消滅となる建玉以外について、お客様は権利放棄はできないものとします。

#### 第53条（オプション売建玉に対する権利行使の割当て）

オプション取引における権利行使が行われた場合、金融商品取引所より割り当てられた数量を、最終取引日までに決済されなかった売建玉に対して当社の定めるところにより割当て、その結果を速やかに開示するものとします。

#### 第54条（決済条件の変更）

お客様は、天災地変、経済事情の激変等その他やむを得ない事由に基づいて、当社が決済条件の変更を行った場合は、その措置に従うものとします。

#### 第55条（取引手数料等）

お客様は、先物・オプション取引の約定が成立したときは、当社が別途定める取引手数料を支払うものとします。

第56条（先物・オプション取引の制限・停止）

1. お客様が法令諸規則、「オンライントレード取引約款」、「先物・オプション取引口座設定約諾書」、「契約締結前交付書面」、または本規定その他当社規定・ルールに違反した場合、当社に対する債務の履行を怠った場合、又はその他やむを得ない事由が生じたものとして当社が判断した場合は、当社は直ちにお客様の先物・オプション取引の制限又は停止することができるものとします。
2. 前項の取引の利用の制限又は停止した場合は、お客様は直ちに期限の利益を喪失するものとし、当社は、それによって生じる損害について、一切の責を負わないものとします。

第57条（債務不履行における遅延損害金）

お客様が本規定に定める履行期日を過ぎても当社に対する債務の履行を怠った場合、当社に対し履行期日の翌日から履行の日まで、金融商品取引所の定めに準じた料率をもって遅延損害金を支払うものとします。

第58条（本規定の変更）

1. この規定は、法令の変更又は監督官庁の指示、その他変更の必要が生じたときに変更を行うことがあります。
2. 変更の内容がお客様の従来の権利を制限するもしくはお客様に新たな義務を課すものである場合は、その旨を通知します。
3. お客様は本規定の変更不同意の場合は、前項に基づく通知の受領後 15 日以内に当社に申し出るものとします。係る申し出がない場合は、本規定の変更同意したものとみなします。
4. 前3項に係らず、第2項に基づく通知の受領後にお客様が新規のお取引を開始された場合は、本規定の変更同意したものとみなします。
5. 前2項の通知は、変更の内容が軽微であると判断される場合は、当社ホームページ上の掲示による方法に代えることができるものとします。

以上

（平成 24 年 12 月 1 日）

# 先物・オプション取引口座設定約諾書

私は、株式会社日本証券クリアリング機構(以下「クリアリング機構」という。)が金融商品取引清算機関として金融商品債務引受業を行う対象とする市場デリバティブ取引(通貨に係るものを除く。)(以下「先物・オプション取引」という。)の特徴、制度の仕組み等取引に関し、貴社から受けた説明の内容を十分把握し、私の判断と責任において先物・オプション取引の委託を行います。つきましては、貴社に先物・オプション取引口座を設定するに際し、金融商品取引法(昭和23年法律第25号。以下「法」という。)その他の法令、先物・オプション取引が行われる金融商品市場を開設する金融商品取引所(第10条第4項並びに第5項第1号及び第2号を除き、以下単に「金融商品取引所」という。)の定款、業務規程、受託契約準則、取引参加者規程、清算・決済規程、先物・オプション取引に係る証拠金及び未決済約定の引継ぎ等に関する規則(以下「証拠金規則」という。)、その他諸規則及び決定事項、クリアリング機構の業務方法書、先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則及び決定事項並びに慣行中、先物・オプション取引の条件に関連する条項に従うとともに、次の各条に掲げる事項を承諾し、これを証するため、この約諾書を差し入れます。なお、本約諾書における用語の意義は、金融商品取引所の定款、業務規程、受託契約準則及び先物・オプション取引に関するこれら諸規則に係る特例、取引参加者規程、清算・決済規程、証拠金規則並びにクリアリング機構の業務方法書及び先物・オプション取引に係る取引証拠金等に関する規則において定めるところに従います。

## (先物・オプション取引口座による処理)

第1条私が今後貴社に対して行う先物・オプション取引のうち私が指定する取引の委託において、次に掲げる事項をすべてこの先物・オプション取引口座で処理すること。

- (1)法第2条第21項第1号に掲げる取引に係る買付代金、売付代金、買付有価証券、売付有価証券、証拠金(取引証拠金及び委託証拠金を含む。以下この条において同じ。)、計算上の損益金、決済に伴う損益金、その他授受する金銭
- (2)法第2条第21項第2号に掲げる取引に係る証拠金、計算上の損益金、決済に伴う損益金、その他授受する金銭
- (3)法第2条第21項第3号に掲げる取引に係る売付け又は買付けに係る取引代金、証拠金、権利行使に伴い授受する有価証券及び金銭(信用取引による売付け又は買付けが成立した場合を除く。)、その他授受する金銭

## (証拠金の目的)

第2条証拠金は、私が貴社に対して負担する先物・オプション取引に係る債務の履行を確保することを目的とするものであること。

2証拠金のうち取引証拠金は、貴社がクリアリング機構に対して支払い若しくは引き渡すべき私の委託に基づく貴社の先物・オプション取引に係る債務の履行を確保すること及び私が貴社に対して負担する先物・オプション取引に係る債務の履行を確保することを目的とするものであること。

3前項の規定にかかわらず、貴社が非清算参加者である場合には、証拠金のうち取引証拠金は、貴社の指定清算参加者がクリアリング機構に対して支払い若しくは引き渡すべき私の委託に基づく貴社の指定清算参加者の先物・オプション取引に係る債務の履行、貴社が貴社の指定清算参加者に対して支払い若しくは引き渡すべき私の委託に基づく貴社の先物・オプション取引に係る債務の履行及び私が貴社に対して負担する先物・オプション取引に係る債務の履行を確保することを目的とするものであること。

## (取引証拠金及び委託証拠金)

第3条私がこの先物・オプション取引口座を通じて貴社に差し入れた証拠金(私の現金支払予定額に相当する額の金銭を除く。以下同じ。)は、貴社が保管するのではなく、私の代理人である貴社(貴社が非清算参加者である場合には、貴社及び貴社の指定清算参加者)が、私の委託に基づく未決済約定に係る取引証拠金としてそのままクリアリング機構に直接預託し、クリアリング機構で保管されること。ただし、私が貴社に証拠金を差し入れた日から起算して4日目(金融商品取引所が定める休業日を除く。)の日までの間は、貴社が取引証拠金としてこれを保管し、貴社自身が所有するこれに相当する金銭又は代用有価証券が差換預託されることがあり得ることについて異議のないこと。

2前項の規定にかかわらず、私が別に書面による同意をした場合は、私が差し入れ又は預託した証拠金の全部又は一部について、次の各号のいずれかに定める方法により、これに相当する金銭又は代用有価証券が差換預託されることがあり得ることについて異議のないこと。

- (1)私が預託した証拠金を貴社が委託証拠金として保管し、これに相当する貴社自身が所有する金銭又は代用有価証券が取

#### 引証拠金としてクリアリング機構に差換預託される方法

- (2)貴社が非清算参加者である場合において、私が預託した証拠金を貴社が委託証拠金として保管し、これに相当する貴社自身が所有する金銭又は代用有価証券が非清算参加者証拠金として貴社の指定清算参加者に預託され、当該非清算参加者証拠金に相当する貴社の指定清算参加者自身が所有する金銭又は代用有価証券が取引証拠金としてクリアリング機構に差換預託される方法

#### (代理人)

第4条私は、貴社(貴社が非清算参加者である場合には、貴社及び貴社の指定清算参加者)を代理人としてクリアリング機構に対する私の取引証拠金の預託及びその返戻を行うこと。

2前項に定める代理は、以下を条件とすること。

(1)私は、前項に定める代理人の解任をしないこと。

(2)貴社に対し、第17条第1項第1号又は第3号の事由により同条第1項に定める支払不能による売買停止等が行われた場合は、前項に定める貴社の代理権は消滅すること。

(3)貴社が非清算参加者である場合において、貴社に対し、第17条第1項第2号又は第4号の事由により同条第1項に定める支払不能による売買停止等が行われたときは、前項に定める貴社の指定清算参加者の代理権は消滅すること。

3私の取引証拠金の預託及びその返戻については、貴社(貴社が非清算参加者の場合には、貴社及び貴社の指定清算参加者)以外の者を代理人としないこと。

#### (取引証拠金及び委託証拠金の返還請求権)

第5条次の各号に掲げる取引証拠金及び委託証拠金に対する返還請求権は、私が貴社に対して負担する先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額(以下「未履行債務額」という。)を控除した額に相当する部分について、私が有すること。

(1)私が差し入れた取引証拠金が直接預託された場合

貴社の直接預託分の取引証拠金(清算参加者委託分の取引証拠金(直接預託分)又は非清算参加者委託分の取引証拠金(直接預託分)をいう。以下同じ。)のうち、私が貴社(貴社が非清算参加者の場合には、貴社及び貴社の指定清算参加者)を代理人としてクリアリング機構に預託したのと同額の金銭又は私が貴社(貴社が非清算参加者の場合には、貴社及び貴社の指定清算参加者)を代理人としてクリアリング機構に預託した代用有価証券

(2)私が委託証拠金を預託し、取引証拠金が差換預託された場合(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われた場合を含む。)

私が預託した委託証拠金(同条第1項ただし書に規定する差換預託が行われた場合における私が貴社に差し入れた取引証拠金を含む。以下この号において同じ。)及び次のa又はbに掲げるもの

a 貴社の差換預託分の取引証拠金(清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)又は非清算参加者委託分の取引証拠金(差換預託分)をいう。以下同じ。)として金銭が預託されている場合は、私が預託した委託証拠金に相当する額の金銭

b 貴社の差換預託分の取引証拠金として代用有価証券が預託されている場合は、当該代用有価証券のうち、私が預託した委託証拠金に相当する額の有価証券

2前項の規定により、私が有する取引証拠金に対する返還請求権は、クリアリング機構に対して私が直接行使することができず、私の代理人である貴社(貴社が非清算参加者の場合には、貴社及び貴社の指定清算参加者)を通じてのみ行使できること。

3貴社が清算参加者である場合においては、第1項に規定する私の未履行債務額(貴社がクリアリング機構に対して支払い又は引き渡すべき私の委託に基づく先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除する。)に相当する部分の取引証拠金に対する返還請求権は、貴社が有すること。

4貴社が非清算参加者である場合においては、第1項に規定する私の未履行債務額に相当する部分の取引証拠金に対する返還請求権は、貴社が貴社の指定清算参加者に対して支払い又は引き渡すべき私の委託に基づく先物・オプション取引に係る債務のうち未履行部分に相当する額を控除した部分について貴社が有し、当該未履行部分について貴社の指定清算参加者が有すること。

#### (差換預託分の取引証拠金に関する返還請求権)

第6条私が委託証拠金を預託し、取引証拠金が差換預託された場合(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われた場合を含む。)は、次の各号に異議のないこと。

(1)私が取引証拠金の全部又は一部の返還請求権を行使した場合には、私が預託した委託証拠金(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われた場合における私が貴社に差し入れた取引証拠金を含む。次号において同じ。)が返還されるこ

と。

(2)第3条第2項に規定する差換預託が行われた場合(同条第1項ただし書に規定する差換預託が行われた場合を含む。)において、私が委託証拠金の全部又は一部の返還を受けたときは、当該返還を受けた委託証拠金に相当する額の限度で、私の有する取引証拠金の返還請求権が貴社に移転すること。

(証拠金の代用有価証券の範囲)

第7条証拠金の差入れ又は預託を有価証券をもって代用する場合については、貴社は、金融商品取引所及びクリアリング機構の規則又は規則に基づく措置により定める範囲のうち貴社が応じられる範囲において有価証券を受け入れることに異議のないこと。

2前項の場合における有価証券の代用価格の計算に係る時価(金融商品取引所及びクリアリング機構の規則に基づき決定される時価をいう。)に乗すべき率については、金融商品取引所及びクリアリング機構の規則又は規則に基づく措置により定める率を超えない率として貴社が設定する率とすることに異議のないこと。

(取引の取消し)

第7条の2過誤のある注文により先物・オプション取引が成立した場合において、金融商品取引所がその規則に基づき、先物・オプション取引の取消しを行ったときは、その措置に従うこと。

2天災地変その他のやむを得ない理由により金融商品取引所のシステム上の取引記録が消失した場合において、当該金融商品取引所が先物・オプション取引の取消しを行ったときは、その措置に従うこと。

3私が貴社に委託した先物・オプション取引の取消しが行われた場合には、当該取り消された取引に係る私の貴社に対する権利及び義務は初めから発生しなかったものとされることに異議のないこと。

4私は、金融商品取引所が先物・オプション取引を取り消したことにより損害を被った場合においても、過誤のある注文を発注した取引参加者に対して、当該発注に際して故意又は重過失が認められる場合を除き、その損害の賠償を請求しないこと。

5私は、金融商品取引所が先物・オプション取引を取り消したことにより損害を被った場合においても、当該金融商品取引所に対して、故意又は重過失が認められる場合を除き、その損害の賠償を請求しないこと。

(権利行使の割当ての処理等)

第8条法第2条第21項第3号に掲げる取引について、クリアリング機構が定める方法により、貴社の顧客の委託に基づく建玉に対し権利行使の割当てが行われた場合において、貴社が貴社の定める方法により割当てを行うことに異議のないこと。

2オプション取引(次項に規定するオプション取引を除く。)について、私が権利行使日において次の各号に定める場合に該当する銘柄について権利行使を行わない旨を所定の時限までに貴社に指示しなかったときは、当該銘柄を上場する金融商品取引所が別に定めた場合を除き、当該銘柄について権利行使の指示を行ったものとみなされることに異議のないこと。

(1)プットオプション(権利行使により当該権利行使をした者が売主としての地位を取得するものをいう。以下同じ。)については、権利行使価格がオプション清算値段、オプション清算指数の数値又はオプション清算数値を上回っている場合

(2)コールオプション(権利行使により当該権利行使をした者が買主としての地位を取得するものをいう。以下同じ。)については、権利行使価格がオプション清算値段、オプション清算指数の数値又はオプション清算数値を下回っている場合

3取引開始の日から取引最終日の終了する日までを権利行使期間とするオプション取引について、私が権利行使期間満了の日において次の各号に定める場合に該当する銘柄について権利行使を行わない旨を所定の時限までに貴社に指示しなかったときは、当該銘柄を上場する金融商品取引所が別に定めた場合を除き、当該銘柄について権利行使の指示を行ったものとみなされることに異議のないこと。

(1)プットオプションについては、権利行使価格が権利行使期間満了の日に終了する取引日における権利行使対象先物限月取引の清算値段を上回っている場合

(2)コールオプションについては、権利行使価格が権利行使期間満了の日に終了する取引日における権利行使対象先物限月取引の清算値段を下回っている場合

4前項に規定するオプション取引について、私が権利行使を委託した場合又は権利行使の割当てを受けた場合において、私が当該権利行使又は当該権利行使の割当てに係る先物取引の限月取引ごとに新規の売付け若しくは新規の買付け又は転売若しくは買戻しの区別及びその数量を所定の時限までに貴社に指示しなかったときは、当該指示をしなかった数量について新規の売付け又は新規の買付けの指示を行ったものとみなされることに異議のないこと。

(決済条件の変更)

第9条金融商品取引所又はクリアリング機構が、天災地変、経済事情の激変、品不足その他やむを得ない理由に基づいて、先物・オプション取引に係る決済物件、権利行使期間、権利行使日、受渡決済期日又は最終決済期日の変更等の決済条件の変

更を行った場合には、その措置に従うこと。

(経過利子の取扱い及び最終清算指数等の変更等)

第10条クリアリング機構が、先物取引の受渡決済において、非課税扱いの申告に係る経過利子の取扱いについて課税扱いの指定を行った場合には、その措置に従うこと。

2指数先物取引における最終決済期日前に特別清算指数又は特別清算数値に誤りがあると認められた場合において、金融商品取引所が当該金融商品取引所の規則に基づき、その変更を行ったときは、その措置に従うこと。

3指数オプション取引における権利行使に係る決済の日の前日までに特別清算指数又は特別清算数値に誤りがあると認められた場合において、金融商品取引所が当該金融商品取引所の規則に基づき、オプション清算指数又はオプション清算数値の変更を行ったときは、その措置に従うこと。

4私が、指数先物取引又は指数オプション取引において、指数の算出若しくは配信の不能、遅延若しくは誤り又は最終清算指数、最終清算数値、オプション清算指数若しくはオプション清算数値の変更により損害を被った場合においても、貴社、金融商品取引所(指数の対象である有価証券を上場する金融商品取引所を含む。以下この項において同じ。)及び指数の算出者(当該算出者から指数の算出に関して業務委託を受けた者を含む。)に対してその損害の賠償を請求しないこと。ただし、貴社又は金融商品取引所に故意又は重過失が認められる場合にあっては、当該故意又は重過失が認められる者に対する請求はこの限りではない。

5有価証券に係るオプション取引の処理について、次の各号に掲げる場合には、当該オプション取引が行われた金融商品取引所の定める方法により行われることに異議のないこと。

- (1)当該オプション取引の対象である有価証券が、いずれの国内の金融商品取引所においても上場されなくなる場合
- (2)当該オプション取引の対象である有価証券が、いずれかの国内の金融商品取引所において売買を停止された場合
- (3)当該オプション取引の対象である有価証券の発行者が会社分割を行った場合
- (4)当該オプション取引の取引状況等を勘案して当該取引に係るオプションの上場廃止を行う場合

(期限の利益の喪失)

第11条私について次の各号の事由のいずれかが生じた場合には、貴社から通知、催告等がなくても貴社に対する先物・オプション取引に係る債務について当然期限の利益を失い、直ちに債務を弁済すること。

- (1)支払いの停止又は破産手続開始、再生手続開始、会社更生手続開始若しくは特別清算開始の申立てがあったとき。
- (2)手形交換所又は電子記録債権法(平成19年法律第102号)第2条第2項に規定する電子債権記録機関の取引停止処分を受けたとき。
- (3)私の貴社に対する先物・オプション取引に係る債権又はその他一切の債権のいずれかについて仮差押、保全差押又は差押の命令、通知が発送されたとき。
- (4)私の貴社に対する先物・オプション取引に係る債務について差し入れている担保の目的物について差押又は競売手続の開始があったとき。
- (5)外国の法令に基づく前各号のいずれかに相当又は類する事由に該当したとき。
- (6)住所変更の届出を怠るなど私の責めに帰すべき事由によって、貴社に私の所在が不明となったとき。

2次の各号の事由のいずれかが生じた場合には、貴社の請求によって貴社に対する先物・オプション取引に係る債務の期限の利益を失い、直ちに債務を弁済すること。

- (1)私の貴社に対する先物・オプション取引に係る債務又はその他一切の債務のいずれかについて一部でも履行を遅滞したとき。
- (2)私の貴社に対する債務(先物・オプション取引に係る債務を除く。)について差し入れている担保の目的物について差押又は競売手続の開始(外国の法令に基づくこれらのいずれかに相当又は類する事由に該当した場合を含む。)があったとき。
- (3)私が貴社との本約諾又はその他一切の取引約定のいずれかに違反したとき。
- (4)前3号のほか債権保全を必要とする相当の事由が生じたとき。

(期限の利益を喪失した場合等における先物・オプション取引の転売又は買戻し等)

第12条私が前条第1項各号のいずれかに該当したときは、私が貴社に設定した先物・オプション取引口座を通じて処理されるすべての先物・オプション取引につき、それを決済するために必要な転売若しくは買戻し、売付契約若しくは買付契約、最終決済、権利行使又は権利行使により成立する有価証券の売付け若しくは買付けに係る契約(これらの委託を含む。以下「転売又は買戻し等」という。)を、私の計算において貴社が任意に行うことに異議のないこと。

2私が前条第2項第1号に掲げる債務のうち、先物・オプション取引に係る債務について一部でも履行を遅滞したときは、当該先物・オプション取引が行われた金融商品取引所の規則により、当該遅滞に係る先物・オプション取引を決済するために必要な



転売又は買戻し等を、私の計算において貴社が任意に行うことに異議のないこと。

3私が前条第2項各号のいずれかに該当したときは、貴社の請求により、貴社の指定する日時までに、私が貴社に設定した先物・オプション取引口座を通じて処理されるすべての先物・オプション取引を決済するために必要な転売又は買戻し等を、貴社に委託して行うこと(前項の規定により貴社が転売又は買戻し等を行う場合を除く。)

4前項の日時までに、私が転売又は買戻し等の委託を行わないときは、貴社が任意に、私の計算においてそれを決済するために必要な転売又は買戻し等を行うことに異議のないこと。

5前各項の転売又は買戻し等を行った結果、損失が生じた場合には、貴社に対して、その額に相当する金銭を直ちに支払うこと。

(貴社に増担保等措置が実施された場合の措置)

第12条の2貴社が、クリアリング機構から増担保等措置(クリアリング機構の業務方法書第29条の2に規定する措置をいう。以下同じ。)を受けた場合(貴社が非清算参加者の場合には、クリアリング機構の業務方法書第29条の2第2項の規定による措置を貴社の指定清算参加者から受けた場合)であって、私の委託に基づく未決済約定が当該措置の事由と密接な関係を有しているときは、貴社が当該措置に従うために必要な範囲内で私に対して次の各号に掲げる措置を行うことに異議のないこと。

(1)証拠金の額の引き上げ

(2)証拠金を有価証券をもって代用する場合における貴社が指定する銘柄の限定

(3)証拠金を有価証券をもって代用する場合の代用価格の計算における時価に乗すべき率の引下げ

(貴社にポジション保有状況の改善指示が行われた場合における建玉の移管)

第12条の3私が正当な理由なく前条の措置に従わないことによって、貴社がクリアリング機構から業務方法書第29条の3の規定に基づきポジション保有状況の改善指示(以下「改善指示」という。)を受けた場合(貴社が非清算参加者である場合には、貴社の指定清算参加者からクリアリング機構の業務方法書第45条の2第1項の規定に基づき要請を受けた場合)には、貴社が、私の委託に基づく未決済約定について、転売又は買戻し等又は貴社以外の取引参加者への引継ぎを要請することがあり得ることに異議がないこと。

2前項の貴社からの要請があった場合において、私が貴社以外の取引参加者に当該未決済約定の引継ぎ(以下「建玉の移管」という。)を希望するときは、私が当該取引参加者に対して、建玉の移管について申し込み、その承諾を受けなければならないことに異議のないこと。

3私が前項の貴社以外の取引参加者の承諾を受けた場合において、私がその旨を貴社に通知したときは、貴社は、建玉の移管について、クリアリング機構(貴社が非清算参加者である場合には、貴社の指定清算参加者)の承認を求めること。

4前項のクリアリング機構(貴社が非清算参加者である場合には、貴社の指定清算参加者)の承認又は否認があった場合には、貴社は、その旨を私に連絡すること。

(貴社に改善指示が行われた場合における先物・オプション取引の転売又は買戻し等)

第12条の4貴社が、私に対して、あらかじめ、合理的な猶予期間を定めて前条第1項の要請をしたにもかかわらず、私が正当な理由なく当該要請に応じなかった場合であって、貴社が、他の方法により改善指示に適合するべく合理的な努力を行ってもなお当該改善指示に適合できないとき(貴社が非清算参加者である場合には、クリアリング機構の業務方法書第45条の2第1項の規定に基づく要請に適合するべく合理的な努力を行ってもなお当該要請に適合できないとき)は、私が貴社に設定した先物・オプション取引口座を通じて処理されるすべての先物・オプション取引につき、私の計算において、それを決済するために必要な転売又は買戻し等を合理的に必要と認められる範囲内で行うことに異議のないこと。

2前項の転売又は買戻し等を行った結果、私が損害を被った場合であっても、貴社及びクリアリング機構(貴社が非清算参加者である場合には、貴社、貴社の指定清算参加者及びクリアリング機構)に対してその損害の賠償を請求しないこと。ただし、貴社、貴社の指定清算参加者及びクリアリング機構に故意又は重過失が認められる場合にあっては、当該故意又は重過失が認められる者に対する請求はこの限りではない。

(取引証拠金等の処分)

第13条私が先物・オプション取引に関し、貴社に対し負担する債務を所定の時限までに履行しないときは、通知、催告を行わず、かつ法律上の手続によらないで、次の各号に掲げるものを、私の計算において、その方法、時期、場所、価格等は貴社の任意で処分し、その取得金から諸費用を差し引いた残額を法定の順序にかかわらず債務の弁済に充当されても異議なく、また当該弁済充当を行った結果、残債務がある場合は直ちに弁済を行うこと。

(1)私が差し入れた代用有価証券が取引証拠金として直接預託された場合には、クリアリング機構に預託されている代用有価証券

(2)私が委託証拠金として預託した代用有価証券

(3)その他金融商品取引に関し、貴社が占有し、又は社債、株式等の振替に関する法律(平成13年法律第75号)に基づく口座に記録している私の有価証券及びその他の動産

(差引計算)

第14条期限の到来、期限の利益の喪失その他の事由によって、貴社に対する債務を履行しなければならない場合には、その債務と私の貴社に対する先物・オプション取引に係る債権その他一切の債権とを、その債権の期限のいかんにかかわらず、いつでも貴社は相殺することができること。

2前項の相殺ができる場合には、貴社は事前の通知及び所定の手続きを省略し、私に代わり諸預け金の払戻しを受け、債務の弁済に充当することもできること。

3前2項によって差引計算をする場合、債権債務の利息、損害金等の計算については、その期間を計算実行の日までとし、債権債務の利率については貴社の定める利率によるものとし、先物・オプション取引に係る貴社に対する債務の遅延損害金の率については当該先物・オプション取引が行われた金融商品取引所の定める率によるものとし、貴社に対するその他の債務の遅延損害金の率については、貴社の定める率によるものとする。

(弁済等充当の順序)

第15条債務の弁済又は前条の差引計算を行う場合、私の債務の全額を消滅させるのに足りないときは、貴社が適当と認める順序方法により充当することができること。

(遅延損害金の支払い)

第16条私が先物・オプション取引に関し、貴社に対する債務の履行を怠ったときは、貴社の請求により、貴社に対し履行期日の翌日より履行の日まで、当該先物・オプション取引が行われた金融商品取引所の定める率による遅延損害金を支払うことに異議のないこと。

(支払不能による売買停止等の場合の措置)

第17条次の各号のいずれかの事由により、金融商品取引所の取引参加者規程の規定に基づき貴社の先物・オプション取引(有価証券等清算取次ぎによるものを除く。)又は有価証券等清算取次ぎの委託の停止(以下「支払不能による売買停止等」という。)が行われ、当該金融商品取引所が貴社の顧客の委託に基づく未決済約定(取引最終日までに転売又は買戻しを行わなかった未決済約定を除く。)について引継ぎ又は転売若しくは買戻し若しくは権利行使(これらの委託を含む。以下同じ。)を行わせることとした場合において、私が貴社以外の当該金融商品取引所が指定する取引参加者に当該未決済約定の引継ぎ(以下「支払不能による売買停止等時の建玉の移管」という。)を行おうとするときは、当該金融商品取引所の定めるところにより、私が当該取引参加者のうちの者に当該支払不能による売買停止等時の建玉の移管について申し込み、当該金融商品取引所が定める日時までにその承諾を受けなければならないことに異議のないこと。

(1)貴社が支払不能となり又はそのおそれがあると認められたことその他特に必要があると認められたこと。

(2)貴社が非清算参加者である場合において、貴社の指定清算参加者が支払不能となり又はそのおそれがあると認められたことその他特に必要があると認められたこと。

(3)貴社が改善指示に違反したこと。

(4)貴社の指定清算参加者が改善指示に違反したこと。

2前項の支払不能による売買停止等時の建玉の移管を行う場合には、私が移管先の取引参加者(以下「移管先取引参加者」という。)に先物・オプション取引口座を設定しなければならないこと。

3第1項の場合において、私が私の委託に基づく未決済約定の転売若しくは買戻し又は権利行使を希望するときは、同項に規定する金融商品取引所の定めるところにより、当該金融商品取引所が定める日時までに、貴社に対しその旨を指示しなければならないことに異議のないこと。

4第1項の場合において、同項に規定する金融商品取引所が定める日時までに、私が第1項の承諾を受けておらず、かつ、前項の指示を行わなかったときは、私の委託に基づく未決済約定は、当該金融商品取引所の定めるところにより、私の計算において任意に転売若しくは買戻し又は権利行使が行われることに異議のないこと。

5前各項の規定にかかわらず、私が、次の各号(第1項第1号の事由に該当していない場合は、第2号を除く。)のいずれかに該当した場合は、私の委託に基づく未決済約定は、第1項に規定する金融商品取引所の定めるところにより、私の計算において任意に転売若しくは買戻し又は権利行使が行われることに異議のないこと。

(1)私が支払不能による売買停止等の前に、第11条に定めるところにより期限の利益を失ったとき。

(2)私が貴社の子会社・親会社であり、かつ、当該金融商品取引所により支払不能による売買停止等時の建玉の移管を行うこ

とが適当でないとき認められたとき。

(差換預託の場合の証拠金の取扱い)

第18条貴社について支払不能による売買停止等が行われた場合において、私が委託証拠金を預託し、取引証拠金が差換預託されていたとき(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われていたときを含む。)は、次の各号に掲げる取扱いが行われることに異議のないこと。

(1)代用有価証券がクリアリング機構に預託されていたときは、クリアリング機構が当該代用有価証券の全部又は一部を換金して、金銭により返還することがあり得ること。この場合において、私とクリアリング機構との間に委任契約が成立していたものとされること。

(2)第5条第1項第2号の規定にかかわらず、次のa又はbのいずれか小さい方の額につき、私の未履行債務額を控除した額に相当する部分について、私が取引証拠金の返還請求権を有すること。

a私が預託した委託証拠金(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われていた場合における私が貴社に差し入れた取引証拠金を含む。以下この号において同じ。)に相当する額

b貴社がクリアリング機構に預託している差換預託分の取引証拠金(前号の規定によりクリアリング機構が換金した場合は、差換預託分の取引証拠金として預託している金銭及び当該換金に係る有価証券以外の有価証券並びに当該換金の後の金銭の額から当該換金に要した費用を差し引いた額の金銭)を、私を含む貴社の各顧客が貴社に預託した委託証拠金に相当する額に応じてあん分した額

2前項の場合において、私の有する返還請求権は、クリアリング機構が同項第1号に規定する換金及び各顧客の返還請求権の額の計算につき要する相当の期間を経過するまではこれを行行使得ず、またクリアリング機構が相当の注意をもってなした返還請求権の額の決定に従うものであること。

(建玉の移管に係る証拠金の取扱い)

第19条第17条第1項の支払不能による売買停止等時の建玉の移管が行われた場合には、次の各号に掲げる取扱いが行われることに異議のないこと。

(1)私が差し入れた取引証拠金が直接預託されていたときは、移管先取引参加者(移管先取引参加者が非清算参加者である場合には、当該移管先取引参加者及びその指定清算参加者)を代理人として取引証拠金を預託していたものとみなされること。

(2)私が委託証拠金を預託し、取引証拠金が差換預託されていたとき(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われていたときを含む。)は、前条第1項第2号の規定により私が返還請求権を有する額について、移管先取引参加者(移管先取引参加者が非清算参加者である場合には、当該移管先取引参加者及びその指定清算参加者)を代理人として取引証拠金を預託していたものとみなされること。

(3)第5条第1項に定める取引証拠金返還請求権は、同条第2項の規定にかかわらず、代理人たる移管先取引参加者(移管先取引参加者が非清算参加者である場合には、当該移管先取引参加者及びその指定清算参加者)を通じてのみ行使できること。

(差換預託の場合の特則)

第20条第17条第1項の支払不能による売買停止等時の建玉の移管が行われた場合において、私が委託証拠金を預託し、取引証拠金が差換預託されていたとき(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われていたときを含む。)は、次の各号に掲げる取扱いが行われることに異議のないこと。

(1)私が貴社に預託した委託証拠金(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われていた場合における私が貴社に差し入れた取引証拠金を含む。以下この条において同じ。)の返還を移管先取引参加者(移管先取引参加者が非清算参加者である場合には、当該移管先取引参加者及びその指定清算参加者)に求めることはできないこと。

(2)前条第3号の規定により取引証拠金返還請求権を行使した場合は、第6条第1号の規定にかかわらず、前条第2号の規定により取引証拠金として預託していたものとみなされる額に相当する額の金銭の返還がなされること。この場合において、当該金額を限度として、私の委託証拠金の返還請求権が消滅すること。

(3)私が前号の規定により取引証拠金の返還を受ける前に、貴社(貴社が非清算参加者である場合には、貴社又は貴社の指定清算参加者)から委託証拠金の全部又は一部の返還を受けた場合は、その限度で、私が有する第5条第1項に定める取引証拠金返還請求権が貴社(貴社が非清算参加者である場合には、貴社又は貴社の指定清算参加者)に移転すること。

(支払不能による売買停止等時の建玉の移管が行われなかった場合の証拠金の取扱い)

第21条金融商品取引所により、貴社について支払不能による売買停止等が行われ、当該金融商品取引所が顧客の委託に

基づく未決済約定について引継ぎ又は転売若しくは買戻し若しくは権利行使を行わせることとした場合(私の委託に基づく未決済約定について第17条第1項の支払不能による売買停止等時の建玉の移管が行われた場合を除く。)には、第5条の規定にかかわらず、次の各号に掲げる取扱いが行われることに異議のないこと。

- (1)私が差し入れた取引証拠金が直接預託されていたときは、第5条第1項第1号に掲げる金銭又は代用有価証券につき、クリアリング機構の定めるところにより、クリアリング機構に対して直接返還請求が行えること。
- (2)私が委託証拠金を預託し、取引証拠金が差換預託されていたとき(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われていたときを含む。)は、第18条第1項第2号の規定により私が返還請求権を有する額に相当する額の金銭につき、クリアリング機構の定めるところにより、クリアリング機構に対して直接返還請求が行えること。この場合において、当該金額を限度として、貴社に対する委託証拠金(第3条第1項ただし書に規定する差換預託が行われていた場合における私が貴社に差し入れた取引証拠金を含む。以下この項において同じ。)の返還請求権が消滅すること。
- (3)私が前号の規定により取引証拠金の返還を受ける前に、貴社(貴社が非清算参加者である場合には、貴社又は貴社の指定清算参加者)から委託証拠金の全部又は一部の返還を受けた場合は、その限度で、私が有する前号に定める取引証拠金返還請求権が貴社(貴社が非清算参加者である場合には、貴社又は貴社の指定清算参加者)に移転すること。

(支払不能による売買停止等に伴う請求)

第22条金融商品取引所により、貴社について支払不能による売買停止等が行われた場合において、この約諾書に定める取扱いその他の当該金融商品取引所又はクリアリング機構の定める規則に基づき行われる取扱いにより、私が損害を被った場合であっても、移管先取引参加者、当該金融商品取引所及びクリアリング機構(貴社が非清算参加者である場合には、貴社の指定清算参加者、移管先取引参加者、当該金融商品取引所及びクリアリング機構)に対してその損害の賠償を請求しないこと。ただし、貴社の指定清算参加者、移管先取引参加者、当該金融商品取引所及びクリアリング機構に故意又は重過失が認められる場合にあっては、当該故意又は重過失が認められる者に対する請求はこの限りではない。

(債権譲渡等の禁止)

第23条私がクリアリング機構及び貴社(貴社が非清算参加者である場合には、クリアリング機構、貴社及び貴社の指定清算参加者)に対して有する債権は、これを他に譲渡又は質入れしないこと。

(証拠金の利息その他の対価)

第24条私が先物・オプション取引に関し、貴社に証拠金として差し入れ又は預託する金銭又は代用有価証券には、利息その他の対価をつけないこと。

(委託時間)

第25条貴社への先物・オプション取引の委託は、貴社が定めた取扱時間内に行うこと。

(報告)

第26条第11条第1項各号及び同条第2項各号のいずれかの事由が生じた場合には、貴社に対し直ちに書面をもってその旨の報告をすること。

(届出事項の変更届出)

第27条貴社に届け出た氏名若しくは名称、印章若しくは署名鑑又は住所若しくは事務所の所在地その他の事項に変更があったときは、貴社に対し直ちに書面をもってその旨の届出をすること。

(報告書等の作成及び提出)

第28条私は、貴社が日本国の法令、金融商品取引所又はクリアリング機構の規則等に基づき要求される場合には、私に係る先物・オプション取引の内容その他を、日本国の政府機関、当該金融商品取引所又はクリアリング機構(貴社が非清算参加者である場合は、日本国の政府機関、当該金融商品取引所又は貴社の指定清算参加者)等宛に報告することに異議のないこと。この場合、私は、貴社の指示に応じて、かかる報告書その他の書類(電磁的記録を含む。次項において同じ。)の作成に協力すること。

2前項の規定に基づき行われたかかる報告書その他の書類の作成及び提供に関して発生した一切の損害については、貴社は免責されること。

(免責事項)

第29条天災地変等の不可抗力その他正当な事由により、私の請求に係る取引証拠金又は委託証拠金等の返還が遅延した場合に生じた損害については、貴社及びクリアリング機構(貴社が非清算参加者である場合には、貴社、貴社の指定清算参加者及びクリアリング機構)がその責めを負わないこと。

2前項の事由による取引証拠金又は委託証拠金等の紛失、滅失、き損等の損害についても貴社及びクリアリング機構(貴社が非清算参加者である場合には、貴社、貴社の指定清算参加者及びクリアリング機構)がその責めを負わないこと。

3貴社が、諸届その他の書類に使用された印影又は署名を届出の印鑑又は署名鑑と相当の注意をもって照合し、相違ないものと認めて取り扱ったうえは、それらの書類につき偽造、変造その他の事故があっても、そのために生じた損害については貴社がその責めを負わないこと。

4金融商品取引所における先物・オプション取引の立会時間内であるにもかかわらず、貴社の取扱時間外であるために、貴社に対して先物・オプション取引の委託ができないことにより生じた損害については、貴社がその責めを負わないこと。

5証拠金所要額の計算の不能、遅延若しくは誤り又は変更によって生じた損害については、貴社、金融商品取引所、クリアリング機構、証拠金所要額の計算に用いる数値の算出者及び提供者並びに証拠金計算方法の開発者及び提供者がその責めを負わないこと。

#### (通知の効力)

第30条私が貴社に届け出た住所又は事務所にて、貴社、金融商品取引所又はクリアリング機構によりなされた先物・オプション取引に関する諸通知が、転居、不在その他私の責めに帰すべき事由により延着し、又は到着しなかった場合においては、通常到達すべき時に到達したものとすること。

#### (適用法)

第31条本約諾は、日本国の法律により支配され、解釈されるものとすること。

#### (合意管轄)

第32条私と貴社との間の先物・オプション取引に関する訴訟については、貴社本店又は支店の所在地を管轄する裁判所のうちから貴社が管轄裁判所を指定することができること。

#### (電磁的方法による書面の授受)

第33条貴社は、その用いる電磁的方法(電子情報処理組織を使用する方法その他の情報通信の技術を利用する方法であって金融商品取引業等に関する内閣府令第57条の3に定める方法と同様の方法をいう。以下同じ。)の種類及び内容を提示し、私の書面又は電磁的方法による承諾を得た場合には、第3条第2項、第26条及び第27条に規定する書面(印章又は署名鑑の変更に係るものを除く。)の受入れに代えて、電磁的方法により、当該書面によるべき同意を得ること若しくは報告又は届出を受けることができること。この場合において、貴社は私から当該書面によるべき同意を得たもの若しくは報告又は届出を受けたものとみなされること。

2私が、前項の規定による承諾をした後に、書面又は電磁的方法により、電磁的方法による同意、報告又は届出を行わない旨の申出をした場合(私が再び前項の規定による承諾をした場合を除く。)は、貴社は、前項の規定に基づき電磁的方法により受け取ることができることとした書面によるべき同意を得ないこと若しくは報告又は届出を受けないこと。

#### (有価証券)

第33条の2この約諾書において、有価証券とは、法第2条第1項に規定する有価証券及び同条第2項の規定により当該有価証券とみなされる権利をいうこと。

以上

2013年7月16日

# 先物・オプション取引に関する確認書 兼 差換預託に関する同意書 兼 先物・オプション取引の差金決済に関する告知に係る申請書

## 先物・オプション取引に関する確認事項

私は、貴社より受領した「オンライントレード取引約款」、「先物・オプション取引規程」、「契約締結前交付書面（先物・オプション）」、「先物・オプション取引口座設定約諾書」、「先物・オプション取引ルール」を受領し、株価指数先物取引および株価指数オプション取引の仕組み、リスク、貴社の取引ルールの内容等について理解の上、その内容を承諾し、私の判断と責任において取引を行います。

## 差換預託に関する同意事項

私は、私が貴社に差し入れる先物・オプション取引口座設定約諾書（以下「約諾書」という。）第3条第2項の規定に基づき、私が差し入れ又は預託した証拠金のうち委託証拠金の全部又は一部につき、貴社による差換預託が行われることについて、ここに同意します。つきましては、約諾書第 17 条の規定により私の委託に基づく未決済約定につき売買停止等時の建玉の移管又は転売若しくは買戻し若しくは権利行使が行われた場合においては、次の各号に掲げる事項につき、一切の異議を申し立てないことを承諾します。

- (1) 株式会社日本証券クリアリング機構は、貴社について支払不能による売買停止等が行われた後遅滞なく、貴社が差換預託分の取引証拠金として預託している代用有価証券を適当と認める方法により換金処分すること。この場合において、当該換金のために要した費用は、当該取引証拠金の額から差し引かれること。
- (2) 私が取引証拠金の返還を求めた場合には、私の預託した委託証拠金が現金であるか代用有価証券であるかにかかわらず、金銭でのみ返還が行われること。
- (3) 私が取引証拠金の返還を求めた場合において、貴社が差換預託分の取引証拠金として預託している代用有価証券に係る相場の変動等のため、私が返還請求権を有する額全額の返還が受けられないことがあり得ること。この場合の未返還額については、未決済約定の引継ぎが行われた場合における引継先の取引参加者（引継先の取引参加者が非清算参加者である場合にはその指定清算参加者を含む。）及び株式会社日本証券クリアリング機構に対しては、一切の請求を行わないこと。

## 先物・オプション取引の差金決済に関する告知に係る申請

私は、先物・オプション取引の差金等決済に関し、所得税法第 224 条の 5 の適用を受けたい旨、ここに申請します。

以上  
(平成 25 年 7 月 16 日)

## 市場デリバティブ取引に係るご注意

- 本取引は、証拠金の額を上回る取引を行うことができることから、場合によっては、大きな損失が発生する可能性を有しています。また、その損失は、差し入れた証拠金の額を上回る場合があります。
- 本取引の内容等を十分ご理解の上、お取引いただきますようお願いいたします。
- お取引内容に関するご確認・ご相談や苦情等につきましては、お客様窓口までお申し出ください。なお、お取引についてのトラブル等は、以下のADR(注)期間における苦情処理・紛争解決の枠組みの利用も可能です。

特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター

電話番号 0120-64-5005 (フリーダイヤル)

(注) ADR とは、裁判外紛争解決制度のことで、訴訟手続きによらず、民事上の紛争を解決しようとする紛争当事者のため、厚生な第三者が関与して、その解決を図る手続きをいいます。

# 指数先物・オプション取引の契約締結前交付書面

～ドットコモディティ社お客様向け提携サービス～

フィリップ証券株式会社

本書は、お客様がフィリップ証券との間で行う指数先物取引・オプション取引についてご理解いただくため、金融商品取引法第 37 条の 3 の規定に従い、交付するものです。



この書面には、株価指数先物・オプション取引を行っていただく上でのリスクや留意点が記載されています。あらかじめ十分にお読みいただき、ご不明な点は、お取引開始前にご確認ください。

- 先物取引とは、ある対象商品を、将来のあらかじめ定められた期日に、現時点で定めた約定価格に基づき売買することを契約する取引です。ただし、期日まで待たずに、反対売買(買い方の場合は転売、売り方の場合は買戻し)を行うことで、契約を解消することも可能です。
- オプション取引とは、ある対象商品を、将来のあらかじめ定められた期日までに、その時の市場動向に関係なくあらかじめ定められた特定の価格で買う権利(コールオプション)又は売る権利(プットオプション)を売買する取引です。ただし、期日まで待たずに、転売又は買戻しを行うことも可能です。
- 指数先物・指数オプション取引は、抽象的な指数を対象商品としたものであり、実際の受渡し不可能なため、期日までに反対売買によって決済されなかった場合には、指数先物取引では、契約時の約定価格と最終清算数値(SQ値)の差額を受払いすることで、指数オプション取引では、権利行使価格と最終清算数値(SQ値)の差額を受払いすることで、いずれも差金決済が行われます。
- 指数先物取引及び指数オプション取引は、多額の利益が得られることもある反面、多額の損失が発生する可能性を合わせもつ取引です。したがって、取引を開始する場合又は継続して行う場合には、取引の仕組みやリスクについて十分に把握するとともに、投資者自らの資力、投資目的及び投資経験等に照らして適切であると判断する場合にのみ、自己の責任において行うことが肝要です。

## 手数料諸費用について

- ・指数先物・オプション取引を行うにあたっては、別紙に記載の取引手数料をお支払い頂きます。
- ・建玉を当社の口座で管理する場合には、口座管理料を頂戴しません。

## 証拠金について

- ・指数先物取引および指数オプション取引(売建て)を行うにあたっては、別紙に記載の証拠金を担保として差し入れまたは預託していただきます。
  - ・証拠金の額は、SPAN(R)により、先物・オプション取引全体の建玉から生じるリスクに応じて計算されますので、指数先物・オプション取引の額の証拠金の額に対する比率は、常に一定ではありません。
- ※ SPAN(R)とは、Chicago Mercantile Exchange が開発した証拠金計算方法で、The Standard Portfolio Analysis of Risk の略です。先物・オプション取引全体の建玉から生じるリスクに応じて証拠金額が計算されます。

## 指数先物取引のリスクについて

指数先物の価格は、対象とする指数の変動等により上下しますので、これにより損失が発生することがあります。また、指数先物取引は、少額の証拠金で当該証拠金の額を上回る取引を行うことができることから、時として多額の損失が発生する可能性を有しています。したがって、指数先物取引の開始にあたっては、下記の内容を十分に把握する必要があります。

- ・市場価格が予想とは反対の方向に変化したときは、短期間のうちに証拠金の大部分またはそのすべてを失うこともあります。また、その損失は証拠金の額を超える場合があります。
- ・指数先物取引の相場の変動により不足額が発生した場合は、証拠金の追加差入れ又は追加預託が必要となります。
- ・所定期限までに証拠金を差入れ又は預託しない場合や、約諾書の定めによりその他の期限の利益の喪失の事由に該当した場合には、損失を被った状態で建玉の一部又は全部を決済される場合もあります。更にこの場合、その決済で生じた損失についても責任を負うこととなります。
- ・金融商品取引所は、取引に異常が生じた場合又はその恐れがある場合や金融商品取引清算機関の決済リスク管理の観点から必要と認められる場合には、証拠金額の引き上げ等の規制措置を取ることがあります。そのため、証拠金の追加差入れ又は追加預託が必要となる場合があります。
- ・市場の状況によっては、意図したとおりの取引ができないこともあります。例えば、市場価格が制限値幅に達したような場合、転売又は買戻しによる決済を希望しても、それができない場合があります。
- ・市場の状況によっては、金融商品取引所が制限値幅を拡大することがあります。その場合、1日の損失が予想を上回ることもあります。

## 指数オプション取引のリスクについて

指数オプションの価格は、対象とする指数の変動等により上下しますので、これにより損失が発生することがあります。なお、オプションを行使できる期間には制限がありますので留意が必要です。また、指数オプションは、市場価格が現実の指数に応じて変動しますので、その変動率は現実の指数に比べて大きくなる傾向があり、場合によっては大きな損失が発生する可能性を有しています。したがって、指数オプション取引の開始にあたっては、下記の内容を十分に把握する必要があります。

- ・市場の状況によっては、意図したとおりの取引ができないこともあります。例えば、市場価格が制限値幅に達したような場合、転売又は買戻しによる決済を希望しても、それができない場合があります。

・市場の状況によっては、金融商品取引所が制限値幅を拡大することがあります。その場合、1日の損失が予想を上回ることもあります。

#### <指数オプションの買方特有のリスク>

・指数オプションは期限商品であり、買方が期日までに権利行使または転売を行わない場合には、権利は消滅します。この場合、買方は投資資金の全額を失うことになります。

#### <指数オプションの売方特有のリスク>

・売方は、証拠金を上回る取引を行うこととなり、市場価格が予想とは反対の方向に変化したときの損失が限定されていません。

・売方は、指数オプション取引が成立したときは、証拠金を差入れ又は預託しなければなりません。その後、相場の変動等により不足額が発生した場合には、証拠金の追加差入れ又は追加預託が必要となります。

・所定の時限までに証拠金を差入れ又は預託しない場合や、約諾書の定めによりその他の期限の利益の喪失の事由に該当した場合には、損失を被った状態で建玉の一部又は全部を決済される場合もあります。更にこの場合、その決済で生じた損失についても責任を負うことになります。

・金融商品取引所は、取引に異常が生じた場合又はその恐れがある場合や金融商品取引清算期間の決済リスク管理の観点から必要と認められる場合には、証拠金額の引き上げ等の規制措置を取ることがあります。そのため、証拠金の追加差入れ又は追加預託が必要となる場合があります。

・売方は、権利行使の割当てを受けた場合には、必ずこれに応じなければなりません。すなわち、売方は、権利行使の割当てを受けた際には、権利行使価格と最終清算数値(SQ 値)の差額の支払いが必要となりますから、特に注意が必要です、

### 指数先物・オプション取引は、クーリング・オフの対象になりません

・指数先物・オプション取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の 6 の規定の適用はありません。

## 【注意】

本書面では、我が国における代表的な指数先物取引及び指数オプション取引に関する一般的な事項について説明しており、当社独自の取引ルールについては、約款、取引規程、ルール等にて、その内容について必ず、ご確認ください。

## 指数先物取引および指数オプション取引の仕組みについて

指数先物取引及び指数オプションは、各金融商品取引所がそれぞれ定める規則に従って行います。(各金融商品取引所で、用語については異なる場合がありますが、制度の基本的な仕組みについてはほぼ同一となっています。)

### 1. 指数先物取引の仕組みについて

#### ○ 取引の方法

##### (1) 対象指数

取引対象の指数は、日経平均株価指数などの各金融商品取引所が指定した指数となります。

##### (2) 取引の期限

指数先物取引(以下の a 及びbに掲げる指数先物取引を除く)は、各金融商品取引所が定める月の第二金曜日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)の前営業日に終了する取引日(各金融商品取引所が定めるところにより、日中取引終了後に設けられているセッションの開始時から翌営業日の日中取引の終了時までの 1 サイクルをいいます。以下、同じ)を取引最終日とする取引(限月取引といいます。)に区分して行います。また、直近限月取引の取引最終日の翌日の日中取引から新しい限月取引が開始されます。

##### a. 米国株価指数先物取引

各限月取引の第三金曜日(休業日又は対象指数が算出されない日にあたるときは、順次繰り上げる。)に終了する取引日を取引最終日とする取引に区分され、直近の限月取引の取引最終日の翌日の日中取引から新しい限月取引が開始されます。

注:各先物取引の取引開始日については、各金融商品取引所のホームページ等により、ご確認ください。

##### b. ボラティリティ指数先物取引

各限月取引の翌月の第二金曜日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)の 30 日前となる日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。)の前営業日に終了する取引日を取引最終日とする取引に区分され、直近の限月取引の取引最終日の翌日の日中取引から新しい限月取引が開始されます。

##### (3) 日中取引終了後の取引

指数先物取引では、各金融商品取引所が定めるところにより、一部の取引を除き、日中取引終了後にもセッションが設けられており、日中取引終了後の取引が可能となっています。当該セッション中に行った取引に係る値洗いや証拠金の差入れ又は預託などは、当該セッションの翌日中取引分と併せて(取引日ごと)に行います。

#### (4) ストラテジー取引

指数先物取引では、各金融商品取引所が定める範囲内で、複数の指数先物取引の売付け又は買付けを同時に行う取引(ストラテジー取引)ができます。

#### (5) 制限値幅

指数先物取引では、各金融商品取引所が定める一部の指数を除き、相場の急激な変化により投資者が不測の損害を被ることがないように、基準値段から、各金融商品取引所が定める一定の値段を加減した制限値幅(1日に変動し得る値幅)を設けています。金融商品取引所は必要に応じて呼値の制限値幅を変更することがあります。

#### (6) 取引の一時中断

指数先物取引では、各金融商品取引所が定める一部の指数を除き、先物価格が大幅に上昇または下落した場合には、原則として取引を一時中断する制度(サーキットブレーカー制度)が設けられています。

#### (7) 取引規制

金融商品取引所が取引に異常があると認める場合又はそのおそれがあると認める場合には、次のような規制措置が取られることがあります。

- a. 制限値幅の縮小
- b. 証拠金の差入日時又は預託日時の繰上げ
- c. 証拠金額の引き上げ
- d. 証拠金の有価証券による代用の制限
- e. 証拠金の代用有価証券の掛目の引下げ
- f. 先物取引の制限または禁止
- g. 建玉制限

### ○ 決済の方法

#### (1) 転売又は買戻しによる決済(反対売買による決済)

株価指数先物取引について、買建玉(又は売建玉)を保有する投資者は、最終の取引日までに転売(又は買戻し)を行い、新規の買付け(又は売付け)を行ったときの約定数値と転売(又は買戻し)を行ったときの約定数値との差に相当する金銭を授受することにより決済することができます。

#### (2) 最終清算数値(SQ値)による決済(最終決済)

最終取引日までに反対売買により決済されなかった建玉は、新規の売付け又は買付けを行ったときの約定数値と最終清算数値(最終の取引日の翌営業日の指数構成銘柄の始値に基づいて算出する特別な指数。SQ値ともいいます。以下同じ)との差に相当する金銭を授受することにより決済されます。

## 2. 指数オプション取引の仕組みについて

### ○ 取引の方法

#### (1) 取引の対象

取引の対象は主に次の2種類とします。

a. 指数プットオプション

対象指数の数値が権利行使価格を下回った場合にその差に各金融商品取引所が定める数値を乗じて得た額を受領することとなる取引を成立させることができる権利

b. 指数コールオプション

対象指数の数値が権利行使価格を上回った場合にその差に各金融商品取引所が定める数値を乗じて得た額を受領することとなる取引を成立させることができる権利

(2) 取引の期限

指数オプション取引は、各金融商品取引所が定める限月取引に区分して行います。また、直近の限月取引の取引最終日の翌日の日中取引から新しい限月取引が開始されます。

(3) 日中取引終了後の取引

指数オプション取引では、各商品取引所が定めるところにより、日中取引終了後にもセッションが設けられており、日中取引終了後の取引が可能となっています。当該セッション中に行った取引に係る証拠金の差入れ又は預託などは、当該セッションの翌日中取引と併せて取引日ごとに行います。

(4) ストラテジー取引

金融商品取引所が定める範囲内で、複数のオプション銘柄の売付け又は買付けを同時に行う取引(ストラテジー取引)ができます。

(5) 制限値幅

相場の急激な変化により投資者が不測の損害を被ることがないように、金融商品は制限値幅(1日に変動し得る値幅)を設けています。

(6) 取引の一時中断

指数先物取引の先物価格が大幅に上昇又は下落した場合には、原則として、指数先物取引を一時中断されることとなっておりますが、同時に指数オプション取引についても取引が一時中断されます。

(7) 取引規制

金融商品取引所が取引に異常があると認める場合又はそのおそれがあると認める場合には、次のような規制措置が取られることがあります。

a. 制限値幅の縮小

b. 証拠金の差入日時又は預託日時の繰上げ

c. 証拠金額の引上げ

d. 証拠金の有価証券による代用の制限

e. 証拠金の代用有価証券の掛目の引下げ

f. 取引代金の決済日前における預託の受入れ

g. 指数オプション取引の制限または禁止

h. 建玉制限

## ○ 権利行使

### (1) 権利行使日

指数オプション取引の権利行使日は、取引最終日の終了する日の翌日のみです。

### (2) 権利行使の指示

買方顧客が権利行使を行う場合には、権利行使その日の各金融商品取引所が定める時限までに金融商品取引業者に対して権利行使を指示しなければなりません。

なお、権利行使日において、イン・ザ・マネーの銘柄については、上記の時限までに買方顧客から権利行使の指示がなくても、買方顧客から権利行使の指示が行われたものとして取扱います。ただし、当該銘柄であっても、買方顧客が権利行使を行わない旨を指示することにより、権利行使を行わないことができます。

(注) イン・ザ・マネーとは、プットオプションについては、権利行使価格が最終清算数値を上回っている場合を、コールオプションについては、権利行使価格が最終清算数値を下回っている場合をいいます。

### (3) 権利行使の割当て

金融商品取引清算機関(以下「清算機関」といいます)は、金融商品取引業者から権利行使の申告があれば、当該銘柄の売建玉を有する金融商品取引業者へ割当てを行い、割当数量を自己分とお客様の委託分とに区分して通知します。

顧客の委託分への割当て通知を受けた金融商品取引業者は、所定の方法により、顧客に割り当てます。

## ○ 決済方法

指数オプション取引の決済には、転売又は買戻しによる決済と権利行使による決済の2つの方法があります。

### (1) 転売又は買戻しによる決済(反対売買による決済)

指数オプション取引について、買建玉(又は売建玉)を保有する投資者は、取引最終日までに転売(又は買戻し)することにより決済することができます。

この場合、買建玉を保有する投資者(買方)は、売却代金を受け取り、売建玉を保有する投資者(売方)は、買戻し代金を支払うこととなります。

### (2) 権利行使による決済

指数オプション取引について、買方は、権利行使を行って買建玉を決済することができます。このとき、権利行使の割当てを受けた売方の売建玉も決済されることとなります。

権利行使の割当てを受けた売方は、権利行使価格と最終清算数値との差に相当する金銭を支払わなければなりません。

## 3. 証拠金について

### (1) 証拠金の差入れ又は預託

証拠金は、次のように算出された総額の不足額又は現金の不足額のいずれか大きな額

以上の額を、不足額が生じた日の翌日までの金融商品取引業者が指定する日時までに差入れ又は預託しなければなりません。

○ 総額の不足額

受入証拠金の総額が証拠金所要額を下回っている場合の差額

○ 現金不足額

証拠金として差入れ又は預託している金銭の額と顧客の現金支払予定額との差額

a 証拠金所要額

先物・オプション取引口座で取引を行っている先物・オプション取引について、次の①から②を差し引いて得た額となります。

① SPAN証拠金額

SPAN証拠金額は、先物・オプション取引の建玉について、SPAN(R)により計算した証拠金額です。

② ネット・オプション価値の総額

ネット・オプション価値の総額は、買オプション価値の総額から売オプション価値の総額を差し引いて得た額です。買オプション価値及び売オプション価値は、次のとおりです。

買オプション価値の総額

: 買建玉が売建玉を上回るオプション取引の銘柄について、清算価格を1単位当たりの金額に換算した額に、売り買い差引数量を乗じて得た額

売オプション価値の総額

: 売建玉が買建玉を上回るオプション取引の銘柄について、清算価格を1単位当たりの金額に換算した額に、売り買い差引数量を乗じて得た額

※ 清算価格は、原則として清算機関が定める理論価格とします。

b 受入証拠金の総額

証拠金として差入れ又は預託している金銭の額±顧客の現金授受予定額

※ 顧客の現金授受(受領又は支払)予定額

: 計算上の損益(利益又は損失)額(先物取引の相場の変動に基づく損益額-計算上の利益の払出額)±顧客との間で授受を終了していない先物取引の決済代金額±顧客との間で授受を終了していないオプション取引の取引代金

※ 先物取引の相場の変動に基づく損益額は、新規の売付け又は買付けにかかる約定数値と前取引日の清算数値との差額に基づき算出されます。

なお、証拠金所要額は清算機関の規則に定められた最低基準であり、実際の額は各金融商品取引業者が定めます。また、金融商品取引業者から証拠金の差入れ又は預託の請求があった場合、速やかにその差入れ又は預託を行わなければ、金融商品取引業者は、その建玉について顧客の計算で転売又は買戻しを行い決済することができます。さらに、差入れ又は預託した証拠金(顧客の現金支払予定額に相当する部分は除きま



す。)は、委託分の取引証拠金として、清算機関にそのまま預託(直接預託)されるか、顧客の同意があればその全部又は一部が金融商品取引業者の保有する金銭又は有価証券に差し換えられて清算機関に預託(差換預託)されることとなります。その際、清算機関への預託の方法(直接預託か差替預託か)により、「取引証拠金」と「委託証拠金」に区分されて取り扱われますが、お客様にとっては本質的に変わるところはありません。

(2) 計算上の利益の払い出し

当社は、指数先物取引にかかる計算上の利益に相当する額の金銭の払い出しはできませんので、ご注意ください。

(3) 証拠金の返還

当社は、顧客が指数先物取引について、顧客が差し入れた又は預託した証拠金から未履行債務額を控除した額について返還を申し入れたときは、当社の出金ルールにそって、原則遅滞なく返還します。

#### 4. 取引参加者破綻時等の建玉の処理について

金融商品取引所の取引参加者に支払不能等の事由が発生した場合には、原則として金融商品取引所が支払不能による売買停止等の措置を講じ、その時に保有している建玉については、次の処理が行われます。

(1) 他の取引参加者に移管する場合

移管しようとする場合は、金融商品取引所が指定した取引参加者に対して顧客が移管の申込みを行い、承諾を得る必要があります。また、移管先の取引参加者に先物・オプション取引口座を設定する必要があります。

(2) 移管せずに転売・買戻し等を行う場合

支払不能による売買停止等の措置を受けた取引参加者に転売・買戻し・権利行使を指示することによって行うこととなります。

(3) 金融商品取引所が指定する日時までに(1)、(2)のいずれも行われない場合

顧客の計算で転売・買戻し・権利行使が行われます。

なお、差し入れ又は預託した証拠金(顧客の現金支払予定額に相当する部分は除きます。)は委託分の取引証拠金として清算機関に直接預託又は差換預託されておりますので、当該取引証拠金については、その範囲内で清算機関の定めるところにより、移管先の取引参加者又は清算機関から返還を受けることができます。

#### 5. 先物・オプション取引及びその委託に関する主要な用語

・ 証拠金(しょうきん)

先物・オプション取引の契約義務の履行を確保するために差し入れ又は預託する金銭をいいます。

- ・ 建玉(たてぎよく)  
先物・オプション取引のうち、決済が終了していないものを建玉といいます。また、買付けのうち、決済が終了していないものを買建玉といい、売付けのうち、決済が終了していないものを売建玉といいます。
- ・ 買戻し(かいもどし)(=買い決済)  
売建玉を決済する(売建玉を減じる)ために行う買付けをいいます。
- ・ 転売(てんばい)(=売り決済)  
買建玉を決済する(買建玉を減じる)ために行う売付けをいいます。
- ・ 限月(げんげつ)  
取引の決済期日の属する月をいいます。先物・オプション取引では同一商品について複数の限月が設定され、それぞれについて取引が行われます。

## 6. 指数先物・オプション取引に係る金融商品取引契約の概要

当社における指数先物・オプション取引については、以下によります。

- ・ 国内の取引所金融商品市場の売買立会による市場への委託注文の取次ぎ
- ・ 指数先物・オプション取引の媒介、取次又は代理
- ・ 指数先物・オプション取引のお取引に関するお客様の金銭又は建玉の管理

## 7. 金融商品取引契約に関する租税の概要

<指数先物・オプション取引に関する租税の概要>

個人のお客様に対する課税は、以下によります。

- ・ 指数先物・オプション取引に係る差金等決済から生じる利益は、他の所得と分離して、事業所得又は雑所得として課税されます。なお、損失が生じた場合には、原則として、他の先物取引等に係る雑所得等との損益通算が可能となります。なお、詳細につきましては、税理士等の専門家にお問い合わせください。

法人のお客様に対する課税は、以下によります。

- ・ 指数先物・オプション取引に係る損益は、法人税に係る所得の計算上、益金の額又は損金の額に参入されます。

## 8. 当社が行う金融商品取引業の内容及び方法の概要等

当社が行う金融商品取引業は、主に金融商品取引法第 28 条第1項の規定に基づく第一種金融商品取引業であり、当社において指数先物・オプション取引を行われる場合は、以下によります。

- ・ 先物・オプション取引口座の開設にあたっては、一定の投資経験、知識、資力等が必要ですので、場合によっては、口座の開設に応じられないこともあります。
- ・ ご注文は、当社が定めた取扱時間内に行ってください。
- ・ ご注文にあたっては、委託する取引対象及び限月、新規および決済の別、売付け又は買付けの別、注文数量、価格(指値、成行等)、委託注文の有効期間等注文の執行に必要な事

項等を明示していただきます。これらの事項を明示していただけなかったときは、ご注文の執行ができない場合があります。また、注文書をご提出いただく場合があります。

- ・注文された指数先物・オプション取引が成立すると、その内容をご確認いただくため、当社から「取引報告書」を交付します。
- ・指数先物・オプション取引について、毎月、期間内のお取引内容及びお取引後の残高を記載した「取引残高報告書」をお客様に交付します。期間内にお取引がない場合は1年に1回以上の交付となります。
- ・万一、記載内容が相違している場合は、速やかに当社へご連絡下さい。

## 当社の概要

商号	等	フィリップ証券株式会社
		金融商品取引業者 登録番号: 関東財務局長(金商)第127号
本店所在地		東京都中央区日本橋兜町4番2号
加入協会		日本証券業協会 / 一般社団法人 金融先物取引業協会
指定紛争解決機関		特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター
資本金	金	9億5015万円
主な事業	業	金融商品取引業
設立	立	1944年4月
連絡先	先	お客様窓口: 0120-881-104

## 1. 手数料について

商品	手数料
日経 225 先物取引	324 円/枚 (税込)
日経 225mini 先物取引	43 円/枚 (税込)
日経平均 VI 先物取引	324 円/枚(税込)
NY ダウ先物取引	216 円/枚(税込)
日経 225 オプション取引	売買代金の 0.216%(税込) 最低手数料 216 円(税込)

※ オプション取引における自動権利行使、割当、消滅、放棄の手数はかかりません。

## 2. 証拠金について

取引を行うための証拠金所要額及び受入証拠金の計算式は以下のとおりとなります。

### (1) 証拠金所要額

証拠金所要額 =

(SPAN 証拠金額 × 当社が定める証拠金掛目) + 先物両建て証拠金 - ネット・オプション価値総額

(注 1) 発注済未約定の注文がある場合は、その分を加味して証拠金所要額を計算します。

(注 2) 当社が定める証拠金掛目は、相場の状況によって、弊社の任意で設定します。なお、掛目については、当社ホームページ上に掲載します。変更時には速やかに掛目およびその適用日を公表します。

(注 3) 先物両建て証拠金とは、指数先物取引において、株価指数の動きに連動しないポジションでも、一定の証拠金を維持していただく金額で、当社の独自ルールとして設定しております。その計算式は、以下のとおりです。

先物両建て証拠金 =

(先物建玉数量 - 先物のネットデルタの絶対値) × 0.5 × 先物 1 枚あたりの SPAN 証拠金額  
× 当社が定める証拠金掛目

### (2) 受入証拠金 (=純資産)

受入証拠金 (=純資産) = (差入証拠金 (=現金)) ± 現金授受予定額

以上

(平成 26 年 4 月 1 日)

# 先物・オプション取引ルール

フィリップ証券株式会社

## 目次

1. 取扱商品
2. 手数料
3. 取引時間・取引日
4. 制限値幅およびサーキット・ブレーカー制度
5. 即時約定可能値幅制度
6. 取引規制
7. 取引チャネル
8. 注文の種類
9. 執行約定条件および有効期限
10. 証拠金の前受け
11. 決済方法
12. 証拠金
13. 追加証拠金(追証)
14. 不足金
15. 入出金

## 1. 取扱商品

### (1) 取扱商品

- ① 大阪取引所上場の日経 225 先物取引
- ② 大阪取引所上場の日経 225 ミニ先物取引
- ③ 大阪取引所上場の日経平均VI先物取引
- ④ 大阪取引所上場のNYダウ先物取引
- ⑤ 大阪取引所上場の日経 225 オプション取引

### (2) 取引単位

商品	取引単位(取引サイズ)
日経 225 先物取引	日経 225 価格の 1,000 倍が 1 取引単位(枚)
日経 225 ミニ先物取引	日経 225 価格の 100 倍が 1 取引単位(枚)
日経平均VI先物取引	日経平均VI価格の 10,000 倍が 1 取引単位(枚)
NYダウ先物取引	NYダウ価格の 100 倍が 1 取引単位(枚)
日経 225 オプション取引	プレミアム価格の 1,000 倍が 1 取引単位(枚)

### (3) 呼値単位

商品	呼値単位	
日経 225 先物取引	10 円	
日経 225 ミニ先物取引	5 円	
日経平均VI先物取引	0.05 ポイント	
NYダウ先物取引	1 ポイント	
日経 225 オプション取引	価格が 50 円以下	1 円
	価格が 50 円以上 1,000 円未満	5 円
	価格が 1,000 円以上	10 円

## 2. 手数料

商品	手数料
日経 225 先物取引	324 円/枚 (税込)
日経 225 ミニ先物取引	43 円/枚 (税込)
日経平均VI先物取引	324 円/枚(税込)
NYダウ先物取引	216 円/枚(税込)
日経 225 オプション取引	売買代金の 0.216%(税込)

	最低手数料 216 円(税込)
--	-----------------

※ オプション取引における自動権利行使、割当、消滅、放棄の手数料はかかりません。

### 3. 取引時間・取引日

#### (1) 取引時間

立会区分	時間帯	注文受付状況
夜間立会	16:00 ~ 16:15	予約注文受付 (バッチ処理状況により開始時間が前後することがあります)
	16:15 ~ 16:30	プレ・オープニング注文受付
	16:30 ~ 02:55	ザラバ
	02:55 ~ 03:00	プレ・クロージング注文受付
	03:00	クロージングオークション(板寄せ)
日中立会	3:00 ~ 08:00	予約注文受付 (処理状況により開始時間が前後することがあります)
	08:00 ~ 09:00	プレ・オープニング注文受付
	09:00 ~ 15:10	ザラバ
	15:10 ~ 15:15	プレ・クロージング注文受付
	15:15	クロージングオークション(板寄せ)
メンテナンス	15:15 ~ 16:00	注文受付停止時間

※ 日経平均VI先物取引については、夜間立会はありません。

#### (2) 各種日付

日付	内容
取引日	取引日とは、大阪 取引所の先物・オプション取引においては、夜間立会の開始時から翌営業日の日中取引の取引終了までをいいます。
決済日	先物・オプション取引の決済日は、約定が成立した取引日の翌営業日です。
SQ 日	当該限月の第 2 金曜日(休業日にあたる場合は前営業日)
取引最終日	SQ 日の前取引日

### 4. 制限値幅およびサーキット・ブレーカー制度

#### (1) 制限値幅

先物・オプション取引においては、大阪取引所によって制限値幅の制度が設けられています。制度概要は以下の通りです。

##### ① 制限値幅の定期見直しについて

- 日経 225 先物取引、日経 225 ミニ先物取引及び日経 225 オプション取引における呼値の制限値幅は、



取引対象指数が同一の商品ごとに、直近期間における呼値の制限値幅の基準値段から算出する制限値幅算定基準値に、それぞれ下の表の比率を乗じて得た値幅を設定し、原則、四半期ごと(3、6、9、12月)に見直す運用としています。

- NYダウ先物取引に係る呼値の制限値幅及び制限値幅算定基準値は CBOT が四半期ごとに設定する CBOT NYダウ先物取引の制限値幅を勘案して設定し、原則、四半期ごと(1、4、7、10月)に見直す運用としています。日経 225 先物取引等の呼値の制限値幅の見直しの時期とは異なるのでご注意ください。
- 日経平均VI先物取引に係る呼値の制限値幅は、基準値段を中心に上下 10 ポイントの範囲内と絶対水準で設定しており、定期的な見直しは行いません。

※ 第二次制限値幅の値を、先物中心限月取引の呼値の制限値段の基準値段で割って得た比率が 2日連続で 20%を上回る場合(日経 225 先物取引、日経 225 ミニ先物取引及び日経 225 オプション取引)、その他当社が必要を認める場合は、臨時で呼値の制限値幅を見直します。

② サーキット・ブレーカー発動時の制限値幅の上限又は(及び)下限の拡大について

- 日経 225 先物取引、日経 225 ミニ先物取引、NYダウ先物取引及び日経 225 オプション取引に係る呼値の制限値幅の拡大については、第一次制限値幅、第二次制限値幅まで拡大していきます。
- 日経平均VI先物取引に係る呼値の制限値幅の拡大については、拡大回数を制限せず、通常、5ポイント刻みで順次拡大します。
- 指数先物取引に係る呼値の制限値幅の拡大については、上限又は下限のうち一方向(例えば、i 上限で取引が成立した場合、又は ii 上限に買呼値が提示されてから5分以上経過して売呼値が提示されない場合でサーキット・ブレーカーが発動したときは上限のみ拡大)にのみ拡大し、指数オプション取引は、上限及び下限の両方向ともに拡大します。

商品		通常時 値幅制限	第一次拡大時 制限値幅	第二次拡大時 制限値幅
指数先物取引	日経 225 先物取引 日経 225 ミニ先物取引	8%	12%	16%
	日経平均VI先物取引	10 ポイント	拡大回数を限定せず、 通常 5 ポイント刻みで順次拡大	
	NYダウ先物取引	10%	20%	30%
指数オプション取引	日経 225 オプション取引	13%	17%	21%

(2) サーキット・ブレーカー(CB)制度

大阪取引所では、相場が過熱してきた場合、取引を一時中断することで投資家の過熱感を鎮め、冷静な判断の機会を設けるための措置として、サーキット・ブレーカー制度が採用されています。制度概要は以下の通りです。

発動条件	先物取引の中心限月取引について、次の①又は②に該当した場合 ① 制限値幅の上限若しくは下限で取引が成立した場合 ② 制限値幅の上限若しくは下限に買(売)呼値が提示されてから 5 分間以上継続して売(買)呼値
------	---

	が提示されず、取引が成立していない場合  制限値幅は、CB 発動状況に応じて段階的に拡大 (制限値幅の拡大は、中断中に実施)
中断対象	発動条件に該当した場合、以下の銘柄の取引を一時中断する。 ① 先物取引の全限月取引 ② 対象株価指数が同一のオプション取引の全限月取引・全銘柄 ③ ①の限月取引に関連するストラテジー取引 ④ ①～②の取引に係る J-Net 取引
適用除外の条件	・14:45 から日中立会終了時まで又は 2:30 から夜間立会終了時まで ・制限値幅拡大後に拡大前の制限値幅の上限(下限)に再び該当した場合等
中断開始	CB 発動条件該当直後の当社がその都度定める時
中断時間	15 分間(発動条件②の場合、10 分間)
再開方法	中断時間経過後、制限値幅を拡大のうえ、板寄せ方式により取引を再開
基準値段	取引日単位で洗替え

## 5. 即時約定可能値幅制度

大阪取引所では、誤発注等による価格急変の防止の観点から、直前の約定値段から所定の値幅を超える約定が発生する注文が発注された場合に、取引の一時中断を行う制度(これを即時約定可能値幅制度と言います。)が採用されています。制度概要は以下のとおりです。

立会における直前の約定数値又は約定価格(ストラテジー取引に係るものを除く。)から、次の区分ごとに次の範囲内とします。ただし当取引日に直前の約定数値又は約定価格がない場合は、当取引日の呼値の制限値幅の基準値段を即時約定可能値幅の基準値段とします。

商品		即時約定可能値幅
指数先物取引	日経 225 先物取引 日経 225 ミニ先物取引	上下 0.8%
	日経平均VI先物取引	上下 10Tick
	NYダウ先物取引	上下 1%
指数オプション取引	日経 225 オプション取引	上下 10Tick

※ 中断時間は、原則として、全商品 1 分です(板寄せ時には適用しません)。

※ 立会終了時における板寄せ方式による取引(クロージング・オークション)を行う場合において、直前の約定数値から上記の値幅を超える場合は、取引を成立させないものとします。

## 6. 取引規制

大阪取引所では、市場の動向に応じて取引規制を行うことがあります。大阪取引所が発動する取引規制は次のとおりとなります。

### (1) 制限値幅の縮小

- (2) 証拠金の差入日時又は預託日時の繰上げ
- (3) 証拠金額の引上げ
- (4) 証拠金の有価証券による代用の制限
- (5) 証拠金の代用有価証券の掛目の引下げ
- (6) 先物・オプション取引の制限又は禁止
- (7) 建玉制限

## 7. 取引チャネル

先物・オプション取引は、パソコンおよびモバイルでお取引ができます。パソコンおよびモバイルの利用可能条件、モバイルにおいては当社指定の端末の範囲内とし、その情報は随時、ホームページ上で掲載いたします。なお、原則、電話注文の受付は行いません。

また、当社におけるモバイル取引は、サポートツールとしてのご提供であり、契約締結前書面の同意機能など、一部ご利用できない機能があります。必ず、パソコンをご用意してお取引ください。

## 8. 注文の種類

注文の種類	概要
(1) 指値注文	価格の限度を指定して発注し、指定した価格又はそれより有利な価格で約定する注文
(2) 成行注文	価格の限度を指定せずに発注し、最良の売呼値又は買呼値と順次対当する注文(注 1)
(3) 最良指値注文	価格の限度を指定せずに発注し、最良の売呼値又は買呼値と対当する注文(注 2)
(4) ストップ注文	売買システムによる受注後において「発注時に指定した板登録条件」を満たしたときに、発注時に指定した条件で板登録される注文(注 3)

(注 1) 成行注文は、未執行数量を注文板に残すことはできません。(未執行数量は必ず失効します)

(注 2) 通常条件又は指定期間条件が付された最良指値注文は、対当する最良の売呼値又は買呼値がないときは、最良の買呼値又は売呼値より、1 ティック優先する値段の指値として板に登録されます。但し、最良の買呼値又は売呼値もない場合は、当該注文は失効します。

(注 3) 板登録条件に合致し、板に登録する際の注文の種類としては、上記(1)から(3)までのものを発注時に条件として指定することができます。

## 9. 執行約定条件および有効期限

注文を発注する際には、次の執行約定条件のいずれかを指定してください。

有効期限につきましては、直近を含めた 5 営業日もしくは期限指定のない GTC (Good Till Cancel) の指定が可能です。

執行約定条件	概要
FAS (Fill and Store)	一部約定後に未執行数量が残る場合は、当該残数量を有効とする条件
Fak (Fill and Kill)	一部約定後に未執行数量が残る場合は、当該残数量を失効させる条件
Fok (Fill or Kill)	全数量が直ちに約定しない場合は、当該全数量を失効させる条件

※ 執行約定条件および有効期限は、注文を入力する時間帯により、また、選択した注文種類によって、選択できない条件がありますので、ご注意ください。

## 10. 証拠金の前受け

当社、先物・オプション取引は、あらかじめ証拠金を差入れ頂いた範囲内において、当社が定める証拠金所要額にのっとり、新規の注文を承ります。

## 11. 決済方法

### (1) 決済方法

#### ① 反対売買による方法

買建の場合は転売、売建の場合は買戻しを行うことによって決済します。

#### ② SQによる決済方法

##### ● 先物取引

最終取引日を過ぎて未決済建玉を保有している場合は、SQ(特別清算指数)値に基づいて、強制的に反対売買により強制決済を行います。

##### ● オプション取引

###### ➢ 買いオプションの場合

最終取引日を過ぎて未決済建玉を保有している場合は、SQ(特別清算指数)値に基づいて、自動権利処理を行います。自動権利処理により権利行使もしくは消滅が判定されます。

###### ➢ 売りオプションの場合

最終取引日を過ぎて未決済建玉を保有している場合は、SQ(特別清算指数)値に基づいて大阪取引所から割り当てられた数量に応じて、売建玉に対して当社が定めるところにより割当を実施します。

### (2) 計算式

#### ① 先物取引

- 売建玉の場合 : 決済代金 = (建単価 - SQ 値) × 建数量 × 取引サイズ - (手数料 + 消費税)
- 買建玉の場合 : 決済代金 = (SQ 値 - 建単価) × 建数量 × 取引サイズ - (手数料 + 消費税)

#### ② オプション取引

##### ● 権利行使・権利消滅

###### ➢ コールオプション[権利行使]

$(SQ \text{ 値} - \text{買建玉の権利行使価格}) \times \text{数量} \times 1,000 - (\text{手数料} + \text{消費税}) = \text{決済代金} \geq 0$

###### ➢ プットオプション[権利行使]

$(\text{買建玉の権利行使価格} - SQ \text{ 値}) \times \text{数量} \times 1,000 - (\text{手数料} + \text{消費税}) = \text{決済代金} \geq 0$

###### ➢ コールオプション[権利消滅]

$(SQ \text{ 値} - \text{買建玉の権利行使価格}) \times \text{数量} \times 1,000 - (\text{手数料} + \text{消費税}) = \text{決済代金} < 0$

###### ➢ プットオプション[権利消滅]

$(\text{買建玉の権利行使価格} - SQ \text{ 値}) \times \text{数量} \times 1,000 - (\text{手数料} + \text{消費税}) = \text{決済代金} < 0$

##### ● 割当・割当なし

➢  $(\text{売建玉の権利行使価格} - SQ \text{ 値}) \times \text{数量} \times 1,000 + (\text{手数料} + \text{消費税})$

➢  $(SQ \text{ 値} - \text{売建玉の権利行使価格}) \times \text{数量} \times 1,000 - (\text{手数料} + \text{消費税})$

## 12. 証拠金

### (1) 取引所証拠金所要額 (= 維持証拠金)

取引所で定められた先物取引およびオプション取引の建玉に必要な証拠金を取引所証拠金所要額(一般には、証拠金所要額といいます)、後述の当社独自証拠金所要額を定めるため、取引所証拠金額として区別します)といい、下記の計算式で計算します。

$$\text{取引所証拠金所要額} = \text{SPAN証拠金額} - \text{ネット・オプション価値の総額}$$

(2) SPAN 証拠金

SPANとは、CMEが1988年に開発したリスクベースの証拠金計算システム(計算メソドロジー及びそのための計算システム)で、The Standard Portfolio Analysis of Risk の略です。SPANは、全世界主要各国の先物・オプション取引所で採用されているグローバルスタンダードのシステムであり、大阪取引の先物取引およびオプションで採用されています。SPANは、各市場参加者が保有する先物・オプション等の金融商品のポートフォリオ全体におけるリスクを包括的に見積もります。先物取引のSPAN証拠金は、毎週取引所により見直しが行われます。また、オプション取引のSPAN 証拠金は、一日一回取引所が見直しを行います。

(3) ネット・オプション価値の総額

ネット・オプション価値の総額とは、ポートフォリオにおけるオプションの清算価値であり、デフォルト等によってポジションを清算する場合におけるオプションの清算コストやオプションの権利行使された場合に生じるリスクをカバーするために考慮するものであり、下記の計算式で算出します。

$$\text{ネット・オプション価値の総額} = \text{買オプション価値の総額} - \text{売オプション価値の総額}$$

$$\text{買オプションの価値} = \text{ロングポジション数} \times \text{清算価格} \times 1,000$$

$$\text{売オプションの価値} = \text{ショートポジション数} \times \text{清算価格} \times 1,000$$

※ ロングポジション数: 買建玉 - 売建玉 > 0 の場合は、ロングポジションといい、計算結果がロングポジション数。

※ ショートポジション数: 買建玉 - 売建玉 < 0 の場合は、ショートポジションといい、計算結果の絶対値がショートポジション数

(4) 当社証拠金所要額

当社証拠金所要額は、取引所で定める取引所証拠金所要額とは別に、当社独自に定める証拠金所要額です。当社証拠金所要額は、発注審査等に利用します。発注審査に利用することから、保守的な証拠金所要額の計算となるように、下記の計算式で算出しています。

$$\text{当社証拠金所要額} =$$

$$\text{SPAN証拠金額} \times \text{当社が定める証拠金掛目} + \text{先物両建て証拠金} - \text{ネット・オプション価値の総額}$$

(5) 当社が定める証拠金掛目

当社が定める証拠金掛目は、当社証拠金所要額算出に利用します。当社証拠金所要額は発注審査に利用することから、取引所証拠金所要額よりも保守的な計算とし、当社独自で設定した掛目をSPAN証拠金に乗じます。なお、当掛目は、100%以上にて相場の変動等を考慮して当社任意で設定するものとします。証拠金掛目変更時は、当社ホームページ等で証拠金掛目および変更日時を公表するものとします。

(6) 当社先物両建て証拠金

SPAN証拠金の計算は、全体のポートフォリオのリスク管理を行う前提のため、先物取引における両建て時には、その売り、買いそれぞれのリスクを相殺します。発注審査においては、当社独自で先物両建て証拠金として、当社証拠金所領額の算出の際に加えます。計算式は、下記のとおりです。

先物両建て証拠金 =

(両建て建玉枚数 - ネットデルタの絶対値) × 0.5 × 商品 1 枚当たりのSPAN証拠金 × 当社が定める証拠金掛目

(7) 当社受入証拠金 (=純資産)

当社がお客様から受け入れている証拠金の額です。お客様が当社に証拠金として差し入れ又は預託している金銭の額 (= 差入証拠金) から、現金授受予定額を加減することにより、算出した額です。その計算式は、以下のとおりとなります。

当社受入証拠金 = 差入証拠金 + 現金授受予定額

(8) 差入証拠金 (=現金)

お客様が当社に証拠金として差し入れ又は預託している金銭の額です。

(9) 当社現金授受予定額

先物取引における計算上の損益額および未決済の決済代金額並びに未決済のオプション取引代金 (指数オプション取引における権利行使に伴う差金を含む) の合計額で算出いたします。

当社現金授受予定額 =

先物取引計算上損益額 + 先物取引未清算決済代金 + オプション取引未清算取引代金

(10) 先物取引計算上損益額 (=値洗い)

先物取引における相場の変動に基づく計算上の利益と損失を合計した金額いわゆる評価損益額になります。

(11) 先物取引の未決済の決済代金及び未決済のオプション取引代金 (=当営業日実現損益)

先物取引における反対売買、もしくは最終決済によって確定した決済損益額、および当日に約定したオプションの受払代金および権利行使に伴う受払代金になり、それぞれの手数料を加味した金額になります。

### 13. 追加証拠金

(1) 追加証拠金 (追証)

毎取引日の取引終了後に、顧客別に全建玉および当該取引日の全取引の状況等に基づいて、当社受入証拠金の額、取引所証拠金所要額を算出します。この結果、当社受入証拠金の額が、取引所証拠金所要額を下回った場合 (当社受入証拠金 < 取引所証拠金所要額) には、お客様は、不足額以上の追加証拠金 (以下、追証という) を差し入れ又は預託する必要があります。

(2) 差入期限と強制決済

お客様は、追証が発生した場合に翌営業日正午までに不足額以上の入金を行うものとします。差入時限までに入金がなかった場合は、当社任意でお客様の計算により、保有する建玉のすべてを強制決済することができるものとします。

#### 14. 不足金

決済に伴う現金支払予定額が、顧客の差入証拠金を上回った場合は、当該不足額以上を発生日の翌営業日正午までに、別途入金するものとします。

#### 15. 入出金

##### (1) 入金

###### ① パーフェクト口座入金

口座開設時に当社よりお客様専用の入金口座を提示いたします。その口座にご入金いただき、当社がその着金を確認してからの証拠金に反映致します。取扱い時間は、当社の着金確認は原則金融機関営業時間内とします。

###### ② リアルタイム入金

当社が指定する金融機関にインターネット口座をお持ちの場合に利用できる入金サービスです。当社ログイン内のサービス画面からお手続き頂きます。本サービスは一部のメンテナンス時間を除き、原則 24 時間受け付けします。

##### (2) 出金

出金可能金額は、当社が計算する金額の範囲内とし、毎営業日 15:30 までの依頼については、翌営業日にご出金します。出金先の銀行口座はあらかじめ指定いただく振込先の銀行のみ受け付けします。

以上  
(平成 26 年 4 月 1 日)