

## 指数先物・オプション取引の 契約締結前交付書面(野村ネット&コール用)

この書面は、野村ネット&コールにおける指数先物・オプション取引に関するリスクや留意点を記載しており、金融商品取引法第37条の3の規定によってお渡しするものです。あらかじめよくお読みいただき、ご不明な点はお問合せください。

- 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(買方の場合は転売、売方の場合は買戻し)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・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、実際の受渡しが可能ないため、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。

### 手数料など諸費用について

- ・ 野村ネット&コールにおいて指数先物・オプション取引を行うにあたっては、「野村ネット&コール 先物・オプション取引ルール(3.取引手数料(税込))」(別紙)に記載の料率、額及び方法により取引手数料をいただきます。
- ・ 建玉を当社の野村ネット&コールの先物・オプション取引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

- ・ 野村ネット&コールにおいて指数先物取引及び指数オプション取引(売建て)を行うにあ

たっては、「野村ネット&コール 先物・オプション取引ルール(9.証拠金、10.値洗い)」(別紙)に記載の証拠金を担保として差し入れ又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ず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ず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には、短期間のうちに証拠金の大部分又はそのすべてを失うこともあります。また、その損失は差し入れ又は預託した証拠金の額を上回るおそれがあります。
- ・ 指数先物取引の相場の変動や代用有価証券の値下がりにより不足額が発生したときは、証拠金の追加差し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し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おそれがある場合や、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、証拠金額の引上げや証拠金の有価証券による代用の制限等の規制措置を取ることがあります。そのため、証拠金の追加差し入れ又は追加預託や代用有価証券と現金の差し換え等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。

このように指数先物取引は、お客様の差し入れた資金に比べて大きな利益が期待できる反面、価格の変動が予想と違った場合には、損失も大きくなります。従って、指数先物取引を利用するときは、その仕組みをよく知り、お客様ご自身の判断と責任において行なうようお願いいたします。

### **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又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は差し入れ又は預託した証拠金の額を上回るおそれがあります。
- ・ 売方は、指数オプション取引が成立したときは、証拠金を差し入れ又は預託しなければ

なりません。その後、相場の変動や代用有価証券の値下がりにより不足額が発生した場合には、証拠金の追加差し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し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おそれがある場合や、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、証拠金額の引上げや証拠金の有価証券による代用の制限等の規制措置を取ることがあります。そのため、証拠金の追加差し入れ又は追加預託や代用有価証券と現金の差し換え等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ときには、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。

このように指数オプション取引は、お客様の差し入れた資金に比べて大きな利益が期待できる反面、価格の変動が予想と違った場合には、損失も大きくなります。従って、指数オプション取引を利用するときは、その仕組みをよく知り、お客様ご自身の判断と責任において行なうようお願いいたします。

#### **指数先物・オプション取引は、クーリング・オフの対象にはなりません**

- ・ 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。

### **金融商品販売法に係る重要事項のご説明**

#### **○指数先物取引**

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、これにより損失を被るおそれがあります。また、その損失は証拠金の額を上回るおそれがあります。

#### **○指数オプション取引**

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、これにより損失を被るおそれがあります。また、その損失は証拠金の額を上回るおそれがあります。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ご注意ください。

## 指数先物取引及び指数オプション取引の仕組みについて

### 1. 指数先物取引の仕組みについて

(注) 本契約締結前交付書面では、金融商品取引所の指数先物取引に関する一般的な事項について説明しています。野村ネット&コール独自の取引ルールについては、「野村ネット&コール 先物・オプション取引ルール」(別紙)にてその内容を必ずご確認ください。また、本契約締結前交付書面に記載されている商品および取引のうち、野村ネット&コールでの取扱いは、当面、金融商品取引所に上場の日経平均株価指数先物取引となります。

指数先物取引は、金融商品取引所が定める規則に従って行います。

### ○取引の方法

#### (1) 対象指数

取引対象の指数は、東証株価指数(TOPIX)や日経平均株価指数など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

指数先物取引は、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。)の前日(休業日に当たるときは、順次繰り上げる。以下同じ。)に終了する取引日(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日(休業日に当たるときは、順次繰り下げる。)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(以下「限月取引」といいます。)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

指数先物取引では、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し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、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、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、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、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、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. 指数先物取引の制限又は禁止
- 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)

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、取引最終日までに転売(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)

取引最終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(金融商品取引所が定める特別な指数。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

(注) 本契約締結前交付書面では、金融商品取引所の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います。野村ネット&コール独自の取引ルールについては、「野村ネット&コール 先物・オプション取引ルール」(別紙)にてその内容を必ずご確認ください。また、本契約締結前交付書面に記載されている商品および取引のうち、野村ネット&コールでの取扱いは、当面、金融商品取引所に上場の日経平均株価指数オプション取引となります。

指数オプション取引には、東証株価指数(TOPIX)オプション取引や日経平均株価指数オプション取引などがあり、商品ごとに金融商品取引所が定める規則に従って行います。

### ○取引の方法

#### (1) 取引の対象

取引の対象は次の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

指数の数値が権利行使価格を上回った場合にその差に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、金融商品取引所が定める限月取引(通常限月取引及び週次設定限月取引を指します)に区分して行います。

また、直近のそれぞれの限月取引の取引最終日の翌日の日中取引から新しいそれぞれの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、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し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

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なう取引(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、金融商品取引所は、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、指数先物取引が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又は禁止
- 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、権利行使日の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り扱います。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」という。)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保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顧客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の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。

(金融商品取引所における指数先物取引及び指数オプション取引の清算機関は株式会社日本証券クリアリング機構となっています。)

## ○決済の方法

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、買付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、権利行使を行い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になります。

権利行使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

(注) 本契約締結前交付書面では、金融商品取引所の指数先物・指数オプション取引の証拠金に関する一般的な事項について説明しています。証拠金に関する野村ネット&コール独自の取扱いについては、「野村ネット&コール 先物・オプション取引ルール」(別紙)にてその内容を必ずご確認ください。

野村ネット&コールの先物・オプション取引口座では、証拠金の差し入れは現金のみとなります。株式等(代用有価証券)の差し入れはできません。

## (1) 証拠金の差し入れ又は預託

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（顧客が非居住者の場合は不足額が生じた日から起算して3日目の日）までの金融商品取引業者が指定する日時までに差し入れ又は預託しなければなりません。

なお、証拠金は有価証券による代用が可能ですが、現金不足額に相当する額の証拠金は、必ず現金で差し入れ又は預託しなければなりません。

＊先物・オプション取引口座ごとに計算します。

### ● 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

証拠金として差し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

同じ先物・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。

＊先物・オプション取引とは、国債先物取引、国債先物オプション取引、指数先物取引、指数オプション取引及び有価証券オプション取引をいいます。

##### 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

＊オプション取引とは、国債先物オプション取引、指数オプション取引及び有価証券オプション取引をいいます。

＊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

証拠金として差し入れ又は預託している金銭の額＋代用有価証券の額（有価証券の時価×掛

#### 目) 土顧客の現金授受予定額

\* 受入証拠金の総額は、先物・オプション取引口座ごとに計算します。

\* 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損益額 ± 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－顧客の負担すべきもので金融商品取引業者が必要と認める額

\* 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係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、他の先物取引を、同じ先物・オプション取引口座において行っている場合には、その損益額を含みます。

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し入れ又は預託の請求があった場合、速やかにその差し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(直接預託か差換預託か)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ことはありません。

#### **(2) 計算上の利益の払出し**

指数先物取引(有価証券指数等先物取引)に係る計算上の利益に相当する額の金銭については、受入証拠金の総額が証拠金所要額を上回っているときの差額を限度として、委託している金融商品取引業者に請求することにより、払出しを受けることができます。

なお、計算上の利益の払出しを行っている場合には、建玉を決済したときの利益額と相殺されます。

#### **(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、原則として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)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規則に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。

#### 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、取次ぎ又は代理
- ・ 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

#### 金融商品取引契約に関する租税の概要

##### <指数先物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。

- ・ 指数先物取引に係る差金等決済から生じた利益は、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。

## ＜指数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。

- ・ 指数オプション取引に係る差金等決済から生じた利益は、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。

## 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、野村ネット&コールにおいて指数先物・オプション取引を行われる場合は、以下によります。

- ・ お取引にあたっては、あらかじめ「先物・オプション取引口座設定約諾書(野村ネット&コール用)」、「差替預託に関する同意書(野村ネット&コール用)」及び「先物・オプション取引に関する確認書(野村ネット&コール)」を当社に差し入れ、野村ネット&コールの先物・オプション取引口座を開設していただく必要があります。野村ネット&コールの先物・オプション取引に関する金銭・建玉は、すべてこの口座を通して処理されます。なお、約諾書については十分お読みいただき、その写しを保管してください。
- ・ 野村ネット&コールの先物・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取引、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。
- ・ 注文をしたときは、発注時に、成立する取引について新規の売付け、新規の買付け、決済(転売又は買戻し)の別を当社に指示してください。
- ・ 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」が交付されます。
- ・ また、指数先物・オプション取引が成立した後、その建玉が決済されるまでの間、建玉の内容をご確認いただくため、また、お客様と当社との債権、債務の残高をご確認いただくため、当社から毎月「取引残高報告書」が交付されます。
- ・ この「取引報告書」及び「取引残高報告書」の内容は、必ずご確認ください。
- ・ 万一、記載内容が相違しているときは、速やかに野村ネット&コール カスタマーサポートへ直接ご連絡下さい。

### 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(しょうこきん)

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保証金をいいます。

- ・ 建玉(たてぎょく)

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

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

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。

## 当社の概要

|          |                                                                     |
|----------|---------------------------------------------------------------------|
| 商号等      | 野村証券株式会社<br>金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 142 号                              |
| 本店所在地    | 〒103-8011 東京都中央区日本橋 1-9-1                                           |
| 連絡先      | 野村ネット&コールカスタマーサポート<br>0120-142-855 (フリーダイヤルが利用できない場合は 042-303-8500) |
| 加入協会     | 日本証券業協会、一般社団法人日本投資顧問業協会、<br>一般社団法人金融先物取引業協会、<br>一般社団法人第二種金融商品取引業協会  |
| 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      | 100 億円                                                              |
| 主な事業     | 金融商品取引業                                                             |
| 設立年月     | 平成 13 年 5 月                                                         |

## ○お取引内容に関するご確認・ご相談や苦情等について

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、下記連絡先までお申し出ください。

連絡先 野村ネット&コール カスタマーサポート  
0120-142-855 (フリーダイヤルが利用できない場合は 042-303-8500)

## ○指定紛争解決機関のご利用について

お取引についてのトラブル等は、以下のADR(注)機関における苦情処理・紛争解決の枠組みの利用が可能です。

(ADR機関のご利用に際して不明な点等ございましたら、上記の連絡先までご照会ください)

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、訴訟手続によらず、民事上の紛争を解決しようとする紛争の当事者のため、公正な第三者が関与して、その解決を図る手続をいいます。

(0328.16)

## 野村ネット&コール 先物・オプション取引ルール

本ルールでは、野村ネット&コールにおける、金融商品取引所において取引される指数先物取引および指数オプション取引(以下、指数先物取引を「先物取引」、指数オプション取引を「オプション取引」、両取引を総称して「先物・オプション取引」といいます。)について説明しております。また、先物取引に係る説明のうち特に注釈がないものは「日経 225mini」を含めております。時間につきましては 24 時間(0:00～23:59)で記載しております。

野村ネット&コールにおける先物・オプション取引は、インターネットにてお取引(口座開設、ご注文、振替入出金等)を受付けます。(原則、お電話でのお取引は受付けておりません。)

### 1.野村ネット&コールの先物・オプション取引口座の開設

野村ネット&コールにおける先物・オプション取引のご利用にあたっては、野村ネット&コールの証券総合取引口座とは別に、先物・オプション取引口座の開設が必要です。

#### (1) 口座開設基準

- ・ 野村ネット&コールの証券総合取引口座を開設していること。
- ・ 満 20 歳以上 80 歳未満の個人のお客様であること。
- ・ 日本国内にお住まいであること。
- ・ 野村の証券取引約款(野村ネット&コール用)に定めるインターネットサービスの利用条件に合致し、インターネットを利用した取引を行っていただけること。
- ・ 取引報告書等の書面の電子交付等に承諾いただけること。
- ・ 「先物・オプション取引規定(野村ネット&コール)」、「野村ネット&コール 先物・オプション取引ルール」、および「指数先物・オプション取引の契約締結前交付書面(野村ネット&コール用)」の内容を確認し、先物・オプション取引の仕組みやリスク、当社の野村ネット&コール 先物・オプション取引ルール等について理解したうえで、自己の判断と責任によりお取引していただけること。
- ・ 「先物・オプション取引口座設定約諾書(野村ネット&コール用)」、「差換預託に関する同意書(野村ネット&コール用)」、および「先物・オプション取引に関する確認書(野村ネット&コール)」を差し入れていただけること。
- ・ 投資方針・目的、および投資資金の性格が、先物・オプション取引の性格に合致していること。
- ・ 十分な年収または金融資産があること。
- ・ 電話および電子メールにより当社から常に連絡がとれること。
- ・ 証券会社の従業員等でないこと。
- ・ 野村信託銀行の野村 Web プラスローンを利用していないこと。

## (2) 必要書類の差し入れ

次の書類を当社が指定する方法により差し入れていただきます。

- ・ 先物・オプション取引口座設定約諾書(野村ネット&コール用)
- ・ 差換預託に関する同意書(野村ネット&コール用)
- ・ 先物・オプション取引に関する確認書(野村ネット&コール)

※取扱銘柄は金融商品取引所に上場の日経平均株価指数先物・オプション取引となり、証拠金の差し入れは現金のみとなります。

## (3) 口座開設審査

野村ネット&コールの先物・オプション取引口座の開設申請後に、口座開設審査を行っております。

審査にあたり、当社が必要と判断した場合はお電話で確認させていただくことがあります。

口座開設基準を満たしていても審査によりご希望にそえないことがあります。当社はその理由については開示いたしませんのでご了承ください。

審査結果、口座開設完了のご連絡は電子メールで通知いたします。

## 2. 取扱銘柄

野村ネット&コールの先物・オプション取引における取扱銘柄は次のとおりです。

- ・ 日経 225 先物の直近 8 限月
- ・ 日経 225mini の直近 8 限月
- ・ 日経 225 オプションの通常限月取引の直近 10 限月、週次設定限月取引の 4 限月

(当社の日経 225 先物および日経 225mini については、金融商品取引所の日経 225 先物の 13 限月のうち、また、日経 225mini の 16 限月のうち、取引最終日が近い順に 8 限月を、日経 225 オプションについては、金融商品取引所の日経平均株価指数オプション取引の通常限月取引は 19 限月のうち取引最終日が近い順に 10 限月を、週次設定限月取引は 4 限月の全てを取扱います。)

※通常限月取引とは、毎月の第 2 金曜日の前営業日を取引最終日とする限月取引※週次設定限月取引とは、各週の金曜日(毎月の第 2 金曜日を除く)の前営業日を取引最終日とする限月取引

※取扱銘柄は、当社の判断により制限することがあります。

※新規・追加設定銘柄の取扱い

- ・ 先物取引: 新規設定日の夜間取引よりお取引が可能です。
- ・ オプション取引: 新規・追加設定日の夜間取引よりお取引が可能です。

### 3.取引手数料(税込)

#### (1)先物取引の取引手数料(税込)

| 銘柄         | 1 注文あたりの<br>注文枚数 | 新規              | 決済              | SQ 決済           |
|------------|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日経 225 先物  | 10 枚までの注文        | 1 枚あたり<br>540 円 | 1 枚あたり<br>540 円 | 1 枚あたり<br>540 円 |
|            | 11 枚以上の注文        | 1 枚あたり<br>270 円 | 1 枚あたり<br>270 円 | 1 枚あたり<br>540 円 |
| 日経 225mini | 20 枚までの注文        | 1 枚あたり<br>108 円 | 1 枚あたり<br>108 円 | 1 枚あたり<br>108 円 |
|            | 21 枚以上の注文        | 1 枚あたり<br>46 円  | 1 枚あたり<br>46 円  | 1 枚あたり<br>108 円 |

- ・ 先物取引は決済約定時に新規手数料と決済手数料を合わせて徴収します。
  - ・ 強制決済には SQ 決済手数料が適用されます。
- ※一括決済注文は、銘柄、建日、建単価、売買の別が同一の建玉ごとに 1 注文とみなして注文枚数を判定します。

#### (2)オプション取引の取引手数料(税込)

| 銘柄           | 新規                         | 決済                         | SQ 決済                  |
|--------------|----------------------------|----------------------------|------------------------|
| 日経 225 オプション | 約定代金の 0.216%<br>(最低 216 円) | 約定代金の 0.216%<br>(最低 216 円) | 約定代金の 0.216%<br>(最低なし) |

- ・ オプション取引は、新規、決済、SQ 決済の約定ごとに徴収します。
- ・ SQ 決済の権利行使および権利割当は取引手数料がかかります。
- ・ SQ 決済の権利消滅および権利放棄は取引手数料かかりません。
- ・ 強制決済には、決済手数料が適用されます。

※手数料は当社の判断により変更することがあります。

### 4.取引時間

金融商品取引所の立会時間は次のとおりです。

#### (1)日中取引

- ・ オープニング・オークション 9:00
  - ・ レギュラー・セッション 9:00～15:10
  - ・ クロージング・オークション 15:15
- ※15:10～15:15 はプレ・クロージング

## (2) 夜間取引

- ・ オープニング・オークション 16:30
  - ・ レギュラー・セッション 16:30～翌日 2:55 (26:55)
  - ・ クロージング・オークション 翌日 3:00 (27:00)
- ※翌日 2:55 (26:55)～翌日 3:00 (27:00) はプレ・クロージング

## 5. 注文

### (1) 取引単位

- 1 枚の整数倍です。
- 1 枚あたりの取引金額は次のとおりです。
- ・ 日経 225 先物: 日経平均株価指数の 1000 倍
  - ・ 日経 225mini: 日経平均株価指数の 100 倍
  - ・ 日経 225 オプション: プレミアムの 1000 倍

### (2) 呼値の単位

原則、金融商品取引所が定めた呼値の単位に準じます。

### (3) 値幅制限

原則、金融商品取引所が定めた呼値の制限値幅に準じます。

### (4) 注文受付時間

原則、24 時間 365 日ご注文を受付けます。

ただし、次の時間を除きます。

- ・ 日中取引終了後から 16:15 まで、夜間取引終了後から 15 分間
- ・ 定時システムメンテナンス時間
  - ・ 月曜日～金曜日 3:15～5:00
  - ・ 土曜日 3:15～6:00、23:00～日曜日 6:00
- ・ 臨時システムメンテナンス時間

また、注文の種類により、注文の受付時間に制限があります。(6) 注文の種類を参照ください。

## (5)取引種類

### 新規、決済

※先物・オプション取引のご注文の際は、あらかじめ証拠金を野村ネット&コールの先物・オプション取引口座へ振替入金していただく必要があります。

※ご注文は受入証拠金の範囲内となります。(原則、受入証拠金が必要証拠金を下回るご注文はできません。)

### ◎決済注文の方法

#### 【建玉指定決済】

- ・ 建玉を指定する注文方法です。
- ・ 注文時に余力審査を行います。

#### 【数量指定決済注文】

- ・ 建玉を指定せずに、銘柄および数量を指定する注文方法です。
- ・ ノムラ・エクスプレスからの注文となります。
- ・ 注文時に余力審査を行います。

#### 【一括決済注文】

- ・ 全建玉を指値(買いは制限値幅の上限、売りは制限値幅の下限)に注文種別 FAS を設定して発注する注文方法です。
- ・ 注文の有効期間は当日となります。
- ・ 未約定の注文がある場合、一括決済注文は発注できません。
- ・ 注文時に余力審査を行わないため、決済により不足金が発生する場合があります。

※決済注文が一部約定した場合には、評価益(建単価と現在値との差)の多い建玉から、評価益が同一の場合には取引日の古い建玉から決済されます。

## (6)注文の種類

注文の種類は次のとおりです。

[1] 注文価格:指値、成行

[2] 注文種別:FAS、FAK、FOK

| 注文種別                 | 説明                                  |
|----------------------|-------------------------------------|
| FAS (Fill and Store) | 一部約定後に未約定数量が残る場合には、当該残数量を有効とする条件です。 |
| FAK (Fill and Kill)  | 一部約定後に未約定数量が残る場合には、当該残数量を失効させる条件です。 |

|                   |                                   |
|-------------------|-----------------------------------|
| FOK(Fill or Kill) | 全数量が直ちに約定しない場合には、当該全数量を失効させる条件です。 |
|-------------------|-----------------------------------|

[3] 執行条件: 条件なし、逆指値

- ・ 逆指値とは、トリガー価格(注文を執行するための条件となる価格)と注文価格(取引を成立させたい価格)を事前に設定しておくことにより、現在値がトリガー価格に到達した時に発動する注文方法です。トリガー価格は制限値幅の範囲内の設定となります。

◎注文の種類と有効期間の組み合わせ

【通常注文】

| 注文 | 注文種別 | 注文有効期間 |      | 備考                |
|----|------|--------|------|-------------------|
|    |      | 当日     | 週末まで |                   |
| 指値 | FAS  | ○      | ○    | —                 |
|    | FAK  | ○      | ×    | —                 |
|    | FOK  | ○      | ×    | レギュラー・セッションのみ注文可能 |
| 成行 | FAK  | ○      | ×    | —                 |
|    | FOK  | ○      | ×    | レギュラー・セッションのみ注文可能 |

【逆指値注文】

| 注文 | 注文種別 | 注文有効期間 |      | 備考         |
|----|------|--------|------|------------|
|    |      | 当日     | 週末まで |            |
| 指値 | FAS  | ○      | ○    | —          |
|    | FAK  | ○      | ○    | トリガー発動後は当日 |
|    | FOK  | ○      | ○    | トリガー発動後は当日 |
| 成行 | FAK  | ○      | ○    | トリガー発動後は当日 |
|    | FOK  | ○      | ○    | トリガー発動後は当日 |

金融商品取引所にて即時約定可能値幅制度およびサーキット・ブレーカー制度等による一時中断が行われた場合、FAK、FOK が設定されている注文は、取引の一時中断と同時に当該未約定数量は失効されます。一時中断中に受付けた FAK が設定されている注文は一時中断後の板寄せ処理が行われるまで取引所の板に残ります。また、一時中断中に受付けた FOK が設定されている注文は取引所にて失効されます。

※取引の一時中断を行った場合は板寄せ方式により取引再開となります。

(7) 注文有効期間

「当日」または「週末まで」を指定できます。

注文の有効な期間は、次のとおりです。

[1] 当日

発注した日に限り有効な注文です。

- ・ 日中取引の注文は、日中取引において有効です。
- ・ 夜間取引の注文は、夜間取引においてのみ有効です。

[2] 週末まで

発注日が属する週の最終営業日の日中取引終了まで有効な注文です。

ただし、次の点にご留意ください。

- ・ 日中取引にて一部約定した注文は、日中取引終了後に未約定分を失効します。
- ・ 夜間取引にて一部約定した注文は、夜間取引終了後に未約定分を失効します。
- ・ 週末最終営業日の夜間取引へは引き継ぎません。
- ・ 土日を越えて翌週へは引き継ぎません。
- ・ 取引所における発注日付に関する時間優先の原則は適用されません。

<注文の有効期間について>

| 有効期限 | 発注タイミング | 月～金                                                                                 |  |                                                                                     |  |
|------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------|--|
|      |         | 日中取引                                                                                |  | 夜間取引                                                                                |  |
| 当日   | 日中取引    |  |  |                                                                                     |  |
|      | 夜間取引    |                                                                                     |  |  |  |

| 有効期限 | 発注タイミング | 月～木                                                                                  |  |      |  | 金    |  |                                                                                       |  |
|------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------|--|------|--|------|--|---------------------------------------------------------------------------------------|--|
|      |         | 日中取引                                                                                 |  | 夜間取引 |  | 日中取引 |  | 夜間取引                                                                                  |  |
| 週末まで | 日中取引    |  |  |      |  |      |  |                                                                                       |  |
|      | 夜間取引    |                                                                                      |  |      |  |      |  |  |  |

※ 金曜日が休業日の場合には、前営業日に読み替え。

(8) 注文訂正・取消

[1] 注文訂正

- ・ 指値から成行、成行から指値への訂正はできません。訂正する場合は当該注文を取消し後、再度ご注文ください。

[2] 注文取消

- ・ 未約定の注文は、原則として取消することが可能です。

#### (9) 注文失効

次に該当する場合、注文を失効します。

##### [1] 有効期間切れ注文

- ・ 日中取引の当日注文は、日中取引終了後に失効します。
- ・ 夜間取引の当日注文は、夜間取引終了後に失効します。
- ・ 週末までの注文は、週末最終営業日の日中取引終了後に失効します。

##### [2] 一部約定した注文

- ・ 日中取引にて一部約定した場合は、日中取引終了後に未約定分を失効します。
- ・ 夜間取引にて一部約定した場合は、夜間取引終了後に未約定分を失効します。

##### [3] 翌取引日の制限値幅範囲外となった注文

- ・ 日中取引終了後に失効します。

##### [4] 追加証拠金・不足金が発生した場合

- ・ 日中取引終了後、および夜間取引終了後に失効します。

##### [5] 金融商品取引所で失効となった注文

- ・ 注文種別等が金融商品取引所の取引時間に間に合わなかった場合など失効となります。
- ・ 注文種別で FAK、FOK を設定した注文で約定しなかった場合は失効となります。

#### (10) 注文上限、建玉上限

##### [1] 注文上限

1 回の注文の数量は次のとおりです。ただし、決済注文の上限はありません。

- ・ 日経 225 先物は 200 枚まで
- ・ 日経 225mini は 2,000 枚まで
- ・ 日経 225 オプションの買建は 1,000 枚まで
- ・ 日経 225 オプションの売建は、20 枚まで

##### [2] 建玉上限

建玉上限は次のとおりです。

- ・ 「総建玉数量の制限」1,000 枚(先物およびオプションの総建玉で 1,000 枚まで。)
- ・ 「相殺後の建玉数量の制限」200 枚(先物およびオプションそれぞれの同一銘柄の売建玉と買建玉を相殺のうえ、先物については相殺後の超過分とオプションについては相殺後の売超過分を加算して 200 枚まで。)
- ・ 日経 225 オプションの売建は、20 枚(日経 225 オプションの売建玉上限は、ご希望により、所定の審査のうえ、当社が承認した場合に限り拡大することができます。審査によりご希望にそえないことがあります。当社はその理由については開示いたしませんのでご了承ください。)

※日経 225mini は 0.1 枚で計算します。

※上限は当社の判断により変更することがあります。

#### (11) 取引規制

先物・オプション取引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。金融商品取引所が発動する主な規制は次のとおりです。

- ・ 制限値幅の縮小
- ・ 証拠金の差入日時または預託日時の繰上げ
- ・ 証拠金額の引上げ
- ・ 取引代金の決済日前における預託の受入れ
- ・ 指数先物取引の制限または禁止
- ・ 指数オプション取引の制限または禁止
- ・ 建玉制限
- ・ 先物取引等の一時中断措置(サーキットブレーカー制度)

なお、上記以外にも、当社独自の取引規制(必要証拠金・維持証拠金の引上げ等)を行うことがあります。

### 6.取引日、約定日、受渡日

#### (1) 取引日

- ・ 前営業日の夜間取引から当日の日中取引終了時までが同一取引日となります。

#### (2) 約定日

- ・ 日中取引および夜間取引ともに取引が成立した日(実日付)となります。

#### (3) 受渡日

- ・ 日中取引は、取引が成立した日の翌営業日が受渡日になります。
- ・ 夜間取引は、翌日中取引の受渡日と同日(取引日ごと)になります。
- ・ SQ 決済は、SQ 日の翌営業日が受渡日になります。

### 7.取引最終日、SQ 日

#### (1) 取引最終日

- ・ 先物取引の取引最終日は、各限月の第 2 金曜日の前営業日の日中取引までです。夜間取引は行なわれません。(取引最終日が休業日にあたる場合は順次繰り上げます)
- ・ オプション取引の通常限月取引の取引最終日は、各限月の第 2 金曜日の前営業日の日中取引ま

で、週次設定限月取引の取引最終日は各週の金曜日(毎月の第2金曜日を除く)の前営業日の日中取引までです。夜間取引は行なわれません。(取引最終日が休業日にあたる場合は前営業日に繰り上げます)

## (2)SQ 日

- ・ SQ 日は、取引最終日の翌営業日となります。(休業日にあたる場合は順次繰り上げます。)
- ・ 取引最終日を過ぎて未決済建玉がある場合は、金融商品取引所が定める SQ 値に基づいて決済されます。

※SQ 日:先物は最終決済日、オプションは権利行使日(以下 SQ 日)

※SQ 値:先物は最終清算数値、オプションは特別清算数値(以下 SQ)

## 8.SQ 決済

取引最終日を過ぎて未決済建玉がある場合は、金融商品取引所が定める SQ 値に基づいて決済されます。

SQ 値による決済は、SQ 日の 17:00～18:00 頃に行います。

### (1)先物取引

決済代金は次のとおりです。

※取引手数料は新規手数料と決済手数料の合計額になります。

#### [1]日経 225 先物

買建玉

決済代金 = (SQ 値 - 取引最終日の清算数値) × 建玉数量 × 1,000 - (手数料(税込))

売建玉

決済代金 = (取引最終日の清算数値 - SQ 値) × 建玉数量 × 1,000 - (手数料(税込))

#### [2]日経 225mini

買建玉

決済代金 = (SQ 値 - 取引最終日の清算数値) × 建玉数量 × 100 - (手数料(税込))

売建玉

決済代金 = (取引最終日の清算数値 - SQ 値) × 建玉数量 × 100 - (手数料(税込))

### (2)オプション取引

- ・ オプションの未決済買建玉のうちイン・ザ・マネーの銘柄については、SQ 日に自動権利行使されるため、お客様ご自身で権利放棄することはできません。(イン・ザ・マネーの判定には手数料は考慮されません。)
- ・ オプション買建玉の権利行使が行われた場合には、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」といいます。)より割り当てられた数量を、売建玉をお持ちのお客様に当社が定める

方法により割り当てます。

※イン・ザ・マネーとは、コールオプションについては SQ 値が権利行使価格を上回っている場合、プットオプションについては SQ 値が権利行使価格を下回っている場合をいいます。

決済代金は次のとおりです。

#### [1] 日経 225 オプション

コールの買建玉

決済代金 = (SQ 値 - 権利行使価格) × 建玉数量 × 1,000 - (手数料(税込))

※権利行使価格 ≥ SQ 値の場合には、権利が放棄され、決済代金はありません。

コールの売建玉

決済代金 = (権利行使価格 - SQ 値) × 建玉数量 × 1,000 - (手数料(税込))

※権利行使価格 ≤ SQ 値の場合には、権利が消滅し、決済代金はありません。

プットの買建玉

決済代金 = (権利行使価格 - SQ 値) × 建玉数量 × 1,000 - (手数料(税込))

※権利行使価格 ≤ SQ 値の場合には、権利が放棄され、決済代金はありません。

プットの売建玉

決済代金 = (SQ 値 - 権利行使価格) × 建玉数量 × 1,000 - (手数料(税込))

※権利行使価格 ≥ SQ 値の場合には、権利が消滅し、決済代金はありません。

## 9. 証拠金

先物・オプション取引のお取引にあたっては、あらかじめ証拠金を差し入れる必要があります。野村ネット&コールの先物・オプション取引の証拠金額はクリアリング機構の採用する SPAN(R) で計算した証拠金額を基に当社で定めます。

※証拠金は金融商品取引所の規制等または当社独自の規制等により変更することがあります。

### (1) 必要証拠金

必要証拠金 = (SPAN 証拠金額 × 100%) - ネット・オプション価値の総額

ただし、プライス・スキャンレンジが 60 万円を下回る場合には、原則として、プライス・スキャンレンジに SPAN 証拠金額に対する掛け目を乗じて得た金額が 60 万円以上となるよう、SPAN 証拠金額に対する掛け目を設定します。当該掛け目(%)については、1 の位以下を切り上げて設定します。

※プライス・スキャンレンジは、過去一定期間における原資産の日々の変動状況に基づき、クリアリング機構が定める SPAN パラメータです。詳しくはクリアリング機構のホームページをご参照ください。

・ 必要証拠金は、建玉と注文を考慮して算出します。

### (2) 維持証拠金

維持証拠金 = (SPAN 証拠金額 × 100%) - ネット・オプション価値の総額

ただし、プライス・スキャンレンジが 60 万円を下回る場合には、原則として、プライス・スキャンレンジに

SPAN 証拠金額に対する掛け目を乗じて得た金額が 60 万円以上となるよう、SPAN 証拠金額に対する掛け目を設定します。当該掛け目(%)については、1 の位以下を切り上げて設定します。

- ・維持証拠金は、建玉を対象として算出します。

### (3) 受入証拠金

- ・受入証拠金は、お客様が当社(野村ネット&コールの先物・オプション取引口座)に差し入れている金銭の額に、先物取引における計算上の損益額と先物・オプション取引における未受渡分の決済損益額・受渡代金を加減し、未約定のオプション注文に係る手数料額とオプション買い注文に関する想定約定代金を差し引いて計算します。
- ・先物・オプション取引では、証拠金の差し入れは現金のみとなります。株式等(代用有価証券)の差し入れはできません。

※SPAN(R)とは、シカゴ・マーカンタイル取引所(Chicago Mercantile Exchange)が 1988 年に開発したリスクベースの証拠金計算方法およびシステムのことで、Standard Portfolio Analysis of Risk の略です。詳しくはクリアリング機構のホームページをご参照ください。

※ネット・オプション価値の総額は、買いオプション価値の総額から売りオプション価値の総額を差し引いて得た額です。

## 10. 値洗い

毎営業日の 16:00 頃、全建玉および証拠金の値洗いを行います。

先物の建玉は当日終値(最終気配値がある場合はその気配値)を用いて、またオプションの建玉は当日「クリアリング機構」が発表する SPAN(R) パラメータを用いて値洗いを行います。

当日の値洗いの結果生じた前営業日との差額は受入証拠金に加減されます。

### (1) 追加証拠金

#### [1] 追加証拠金の振替入金期限

値洗いの結果、受入証拠金が維持証拠金を下回った場合は証拠金不足(追加証拠金)となります。

お客様の野村ネット&コールの先物・オプション取引口座において追加証拠金が生じた場合は、追加証拠金発生日の翌営業日の 12:00 までに追加証拠金相当額(必要入金額)以上の金額を野村ネット&コールの先物・オプション取引口座に振替入金していただく必要があります。

※追加証拠金が発生した場合、営業日の 16:00 頃お客様の口座状況に「追証発生」と「必要入金額」が表示されますので、日々必ずご確認ください。

※追加証拠金発生後は、新規建注文、振替出金のお取引を制限させていただきます。

#### [2] 期限までに振替入金いただけない場合の対応

当社で振替入金期限に必要な入金額の振替入金が確認できない場合、原則として追加証拠金発生日の翌営業日の 12:15 頃に当社の任意によりお客様の全建玉を決済(強制決済)します。

※強制決済は指値(買いは制限値幅の上限、売りは制限値幅の下限)に注文種別 FAS を設定して注文します。

※強制決済後は、以後の取引を制限させていただくことがあります。

## (2) 不足金

### [1] 不足金の振替入金期限

先物・オプション取引の決済等による差損金の額が受入証拠金の額を上回った場合は不足金となります。お客様の野村ネット&コールの先物・オプション取引口座において不足金が生じた場合は、不足金発生日の翌営業日の 12:00 までに不足金相当額(必要入金額)以上の金額を先物・オプション取引口座に振替入金していただく必要があります。

※不足金が発生した場合、営業日の 16:00 頃お客様の口座状況に「追証発生」と「必要入金額」が表示されますので、日々必ずご確認ください。

### [2] 期限までに振替入金いただけない場合の対応

当社で振替入金期限に必要な入金額の振替入金が確認できない場合、原則として追加証拠金発生日の翌営業日の 12:15 頃に当社の任意によりお客様の全建玉を決済(強制決済)します。

※強制決済は指値(買いは制限値幅の上限、売りは制限値幅の下限)に注文種別 FAS を設定して注文します。

※強制決済後は、以後の取引を制限させていただくことがあります。

※発生した不足金を入金いただけない場合、当社の任意により、お客様の野村ネット&コールの証券総合取引口座から野村ネット&コールの先物・オプション取引口座への振替入金手続きを行うことがあります。その際、不足金の充当に必要な場合にあっては、当社の任意によりお預かりするお客様の株式等の資産を処分することがあります。また、証券総合取引口座からの出金・出庫指示を当社の任意により取消することがあります。

## 11. 振替入金と振替出金

野村ネット&コールにおける先物・オプション取引の証拠金は、野村ネット&コールの証券総合取引口座から先物・オプション取引口座への振替が必要となります。

※ 直接、金融機関口座から野村ネット&コールの先物・オプション取引口座への振込入金、先物・オプション取引口座から金融機関口座への振込出金はできません。

また、お客様が当社において、野村ネット&コールの証券総合取引口座以外の口座をお持ちであっても、当該口座と野村ネット&コールの先物・オプション取引口座との間で振替入出金はできません。

### (1) 振替入金

(野村ネット&コールの証券総合取引口座→野村ネット&コールの先物・オプション取引口座)

- ・ 営業日の 15:30 までの振替入金は当日付、それ以降の振替は翌営業日付となります。

- ・余力は振替指示完了と同時に増額されます。
- ・振替入金は、野村ネット&コールの証券総合取引口座の振替出金可能額(信用口座開設済の場合は、信用限度額の出金可能額)の範囲内となります。

## (2) 振替出金

(野村ネット&コールの先物・オプション取引口座→野村ネット&コールの証券総合取引口座)

- ・営業日の 17:00 までの振替出金は当日付、それ以降の振替は翌営業日付となります。
- ・余力は振替指示完了と同時に減額されます。
- ・振替出金は、野村ネット&コールの先物・オプション取引口座の振替出金可能額(必要証拠金額を超えた額)の範囲内となります。

## ※振替受付時間

原則、24 時間 365 日受付けます。

ただし、次の時間を除きます。

- ・ 定時システムメンテナンス時間
  - ・ 月曜日～金曜日 3:15～5:00
  - ・ 土曜日 3:15～6:00、23:00～日曜日 6:00
- ・ 臨時システムメンテナンス時間

## 12. その他留意事項

### (1) MRF の取扱い

野村ネット&コールの先物・オプション取引口座を開設されたお客様につきましては、MRF(マネー・リザーブ・ファンド)のお取扱いはできません。先物・オプション取引口座開設時に MRF 口座を解約させていただきます。なお、先物・オプション取引口座が閉鎖された場合、MRF 口座の再開のお申込みがあったものとして取扱います。

### (2) 先物・オプション取引の制限

関係法令、諸規則、「先物・オプション取引口座設定約諾書(野村ネット&コール用)」、「指数先物・オプション取引契約締結前交付書面(野村ネット&コール用)」、および当社規定・取引ルール等を遵守されない場合には、その後のお取引を制限する場合があります。

お客様が満 80 歳となった日以降、原則として新規建の注文を制限します。

### (3) 先物・オプション取引の推奨環境

先物・オプション取引においては、当社が推奨するパソコンの推奨環境を用意いただく必要があります(書面の電子交付等の承諾を含みます)。スマートフォン、タブレットは先物・オプション取引の推奨

端末ではありませんのでご了承ください。

(4) 障害時の取扱い

野村ネット&コールにおける先物・オプション取引の注文等は、インターネットにおいて受け付けいたします。システム障害時を含め、原則として電話による注文等は受け付けておりませんのでご了承ください。

以上  
(0516.16)