指数先物・オプション取引
契約締結前交付書面
および　規程集

株式会社 SBI ネオトレード証券

2023 年 10 月

目　　次

１．指数先物・オプション取引の契約締結前交付書面　・・・・・・・・・・・・・・・２

２．指数先物・オプション取引　取引概要　・・・・・・・・・・・・・・・・・・・１５

３．証券オンライン指数先物および指数オプション取引取扱規程　・・・・・・・・１９

４．指数先物・オプション取引の手数料・諸費用等　・・・・・・・・・・・・・・・２５

５．当社の概要　・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・２７

指数先物・オプション取引の契約締結前交付書面

この書面には、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。あらかじめよくお読みいただき、ご不明な点は、お取引開始前にご確認ください。

〇先物取引とは、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。

〇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）または売る権利（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、転売または買戻しを行うことも可能です。

〇指数先物・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（特別清算数値（金融商品取引所が定める特別な指数又は数値（ＳＱ値ともいいます。以下同じ。））の差額を受払いすることで、指数オプション取引では、権利行使価格とオプション清算数値（特別清算数値（ＳＱ値）。以下同じ。）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。

〇指数先物取引およ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、多額の損失が生じ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また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、投資目的およ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

- 指数先物・オプション取引を行うにあたっては、別紙「指数先物・オプション取引の手数料・諸費用等」に記載の料率、額および方法により取引手数料をいただきます。
- 建玉を当社の口座で管理する場合には、口座管理料は無料です。

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「指数先物・オプション取引　取引概要」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だけに限定されません。

・指数先物取引の相場の変動等により不足額が発生したときは、証拠金の追加差入れまたは追加預託が必要となります。

※　大阪取引所において、同一の先物・オプション口座で指数先物取引以外の先物取引又はオプション取引（指数オプション取引、有価証券オプション取引、商品先物・オプション取引及び国債先物・オプション取引）を取引する場合、当該先物・オプション取引口座内での取引の証拠金は一体として計算・管理されるため、指数先物取引以外の取引において相場の変動により証拠金が不足し、証拠金の追加差入れ又は追加預託が必要になる場合があります。また、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、それが指数先物取引に関して発生したものでなくても、指数先物取引の建玉が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。

・所定の時限までに証拠金を差し入れまた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または全部が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また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または追加預託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、転売または買戻し

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、転売また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、証拠金を差し入れまたは預託しなければなりません。その後、相場の変動等より不足額が発生した場合には、証拠金の追加差入れまたは追加預託が必要となります。

※　大阪取引所において、同一の先物・オプション口座で指数オプション取引以外の先物取引又はオプション取引（指数先物取引、有価証券オプション取引、商品先物・オプション取引及び国債先物・オプション取引）を取引する場合、当該先物・オプション取引口座内での取引の証拠金は一体として計算・管理されるため、指数先物オプション取引以外の取引において相場の変動により証拠金が不足し、証拠金の追加差入れ又は追加預託が必要になる場合があります。また、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、それが指数先物オプション取引に関して発生したも

のでなくても、指数先物オプション取引の建玉が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。

・所定の時限までに証拠金を差し入れまた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または全部が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また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または追加預託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、権利行使価格とオプション清算数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。

【株価指数先物および株価指数オプション取引に関する説明】

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

指数先物取引は、金融商品取引所が定める規則に従って行います。

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、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、順次繰り上げます。）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、順次繰り下げます。）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、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または預託などは、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）祝日等における取引

大阪取引所では、同取引所の定める一部の休業日（祝日等）においても、指数先物取引を行うこが可能です。

※当社では取り扱っておりません。

５）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また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。

※当社では取り扱っておりません。

６）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、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。

７）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。

８）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また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．証拠金の差入日時また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）転売また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（または売建玉）を保有する投資者は、取引最終日までに転売（または買戻し）を行い、新規の買付け（または売付け）を行ったときの約定数値と転売（または買戻し）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。

指数オプション取引の仕組みについて

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

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または預託などは、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）祝日等における取引

大阪取引所では、同取引所の定める一部の休業日（祝日等）においても、指数先物取引を行うこが可能です。

※当社では取り扱っておりません。

5）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また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。

※当社では取り扱っておりません。

6）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、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。

7）取引の一時中断

指数先物取引の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、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。

8）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また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．証拠金の差入日時または預託日時の繰上げ
ｃ．証拠金額の引上げ
ｄ．取引代金の決済日前における預託の受入れ
ｅ．指数オプション取引の制限または禁止
ｆ．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、取引最終日の翌営業日（ＳＱ）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およ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、転売また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）転売また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（または売建玉）を保有する投資者は、取引最終日までに転売（または買戻し）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。

証拠金について

１）証拠金の差し入れまたは預託

証拠金は、次のように算出された総額の不足額また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営業日１１：３０までに差し入れまた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また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を差し引き、③を加え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、有価証券オプション取引、商品先物取引および商品先物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®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。買オプション価値およ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、有価証券オプション取引および商品先物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。

③　取引受渡証拠金

取引受渡証拠金は受渡により決済を行う場合に必要となる証拠金額として、清算機関が定める証拠金額です。

＊取引受渡証拠金は、受渡を伴う商品先物取引についてのみ算出されます。

b．受入証拠金の総額

証拠金として差し入れまたは預託している金銭の額±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（受領または支払）予定額

・計算上の損益（利益または損失）額（先物取引の相場の変動に基づく損益額ー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ー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、新規の売付けまた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し入れまたは預託の請求があった場合、速やかにその差し入れまた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または買戻しを行い決済することができます。

・さらに、差し入れまたは預託した証拠金（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または一部が金融商品取引業者の保有する金銭また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ところはありません。

２）計算上の利益の払い出し

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、払い出しを受けることができます。なお、計算上の利益の払い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、顧客が差し入れたまた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。

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し込みを行い、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、差し入れまたは預託した証拠金（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また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または清算機関から返還を受けることができます。

先物・オプション取引およ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また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、決済が結了していないものを建玉といいます。また、買付けのうち、決済が結了していないものを買建玉といい、売付けのうち、決済が結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。

・オプション清算数値

権利行使日における対象指数の各構成銘柄の金融商品取引所が開設する取引所金融商品市場における売買立会の始めの約定値段（取引最終日の終了する日の翌日に約定値段がない銘柄については、金融商品取引所が定める値段）に基づき算出した特別な指数（特別清算数値（SQ 値））をいいます。

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り次ぎ
・指数先物・オプション取引の媒介、取り次ぎまたは代理
・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または建玉の管理

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、事業所得また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。

法人税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損益は、法人税に係る所得の計算上、益金の額または損金の額に算入されます。

＜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、事業所得また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。

法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損益は、法人税に係る所得の計算上、益金の額または損金の額に算入されます。

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および方法の概要等

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。

- 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」および「差換預託に関する同意書」の内容に同意のうえ、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。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。
- 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、委託する取引対象および限月取引、売付けまたは買付けの別、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、成立する取引又は成立した取引について新規の売付け、新規の買付け、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・応募報告書」が交付されます。
- また、株価指数先物・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、建玉の内容と、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、「取引残高報告書」が交付されます。
- 加えて、保有建玉が決済された際には、決済に係る受渡代金等を確認いただくため、「先物・オプション決済報告書」が交付されます。
- 万一、記載内容が相違しているときは、速やかに当社の管理責任者へ直接ご連絡下さい。

（2022 年９月９日現在）

指数先物・オプション取引　取引概要

口座開設基準

当社の定める方法により、先物・オプション取引口座開設の審査を受け認められること

個人のお客様の場合

- 国内に居住し、かつ口座開設時の年齢が満１８才以上であること
  （※ただし、学生は除く）
- 株式等の投資経験があること
- 投資目的が先物・オプション取引の商品特性に照らして適切であること
- 「指数先物・オプション取引の契約締結前交付書面」および「指数先物・オプション取引　取引概要」等の内容を確認し、かつ株価指数先物・オプション取引の基本的な仕組みが理解できていること
- 金融資産（現金、預貯金、有価証券等）を５００万円以上保有していること
- 本申し込みを行う個人が、法人の代表者または取引担当者として選任され、別に当社において法人名義により株式信用取引、株価指数先物・オプション取引、若しくは CFD 取引を行っている場合、また、その取引において当社の定める約款・規程および諸規則等に反する行為がないこと
- 緊急時において電話連絡が可能であること

法人のお客様の場合

- 国内に本店登記されている事業法人または医療法人、学校法人、もしくは宗教法人等であること
- 株式等の投資経験があること
- 投資目的が先物・オプション取引の商品特性に照らして適切であること
- 有限責任事業組合等、事業を目的とする組合契約を基礎として形成された企業体、もしくは投資組合等でないこと
- 法人登記後１年以上を経過していること
- 事業内容および事業の継続性などを審査し、事業の実態が存在しないまたは登記上の記載と実体が異なる法人（いわゆるペーパーカンパニー）などではないこと
- 法人の代表者または取引担当者として選任された者が、「指数先物・オプション取引の契約締結前書面」および「指数先物・オプション取引　取引概要」等の内容を確認し、かつ先物取引およびオプション取引の基本的な仕組みを理解できていること
- 法人の代表者または取引担当者として選任された者が、別に当社において株式信用取引、株価指数先物・オプション取引、若しくは CFD 取引を行っている場合、また、その取引において当社の定める約款・規程および諸規則等に反する行為がないこと

・当社が必要と認める場合には、決算書あるいは法人税納税証明書等の提出を求める場合があること
・緊急時において電話連絡が可能であること

取扱商品・銘柄

日経株価指数（日経２２５）先物 上場全銘柄
日経株価指数（日経２２５）先物 mini 上場全銘柄
日経株価指数（日経２２５）オプション 上場全銘柄

必要証拠金額

（SPAN 証拠金額×当社が定める SPAN 係数）－（ネットオプション価値の総額）

※SPAN 証拠金額は、当日の日中取引終了時のお客様の総建玉の状況により、株式会社日本証券クリアリング機構が公表する SPAN リスクパラメータに基づき、当社が定める方法により計算します。
※新規に建玉される場合、取引手数料および消費税は、注文中は拘束を行わず、約定時に建玉に対する証拠金所要額として拘束します。
※SPAN 係数については、当社ホームページの取引概要で常時、確認することができます。なお、相場状況等により、当社が任意で変更する場合があります。SPAN 係数変更時には、当社ホームページの取引概要および重要なお知らせに、変更内容を速やかに掲載します。

なお、SPAN 証拠金に基づき当社が計算する証拠金額は、下記の①②③のうち、最も金額のいずれか大きい金額とします。
① 先物売建玉、コールオプション売建玉、プットオプション買建玉および左記取引の未約定新規注文のスキャンリスク合計額
② 先物買建玉、コールオプション買建玉、プットオプション売建玉および左記取引の未約定新規注文のスキャンリスク合計額
③ 売オプション最低証拠金額
※ディープアウトオブザマネーの状態の建玉はスキャンリスクを上回る損失が発生するリスクが高くなっているため、売オプション最低証拠金額を必要証拠金の計算の際に考慮しています。

建玉上限

取扱い商品ごとの、当社が定める建玉の上限枚数については、当社ホームページの取引概要で常時、確認することができます。なお、相場状況等により、当社が任意で変更する場

合があります。変更時は、当社ホームページの取引概要および重要なお知らせに、変更内容を速やかに掲載します。

※必要証拠金は全額前受けとなります。
※お客様からの申告により、上記上限数量枠を拡大する場合もあります。
※必要証拠金の額は、市場の状況等によって適用期間中においても適時変更となる場合があります。

一注文あたりの発注上限

取扱い商品ごとの、当社が定める一注文あたりの注文数量は、当社ホームページで確認することができます。なお、相場状況等により、当社が任意で変更する場合があります。変更時は、当社ホームページの取引概要および重要なお知らせに、変更内容を速やかに掲載します。

※ただし、「証券オンライン取引取扱規程細則」５．注文数量の制限に定める事項に該当する場合は、この限りではありません。

注文の発注

注文の発注、変更および取消は、お客様ご自身が、証券オンライン取引システム（以下、「本システム」といいます。）を通じて行うものとします。

証拠金代用有価証券の取り扱い

代用有価証券の取り扱いはありません。証拠金は全て現金にて預託するものとします。

預託証拠金の最低維持証拠金

最低維持証拠金額は{（SPAN 証拠金×１００％）－（ネットオプション価値の総額）}です。受入証拠金の額が最低維持証拠金を下回ったときは、不足額（「追加証拠金」といいます）を翌営業日１１：３０までに当社に着金が確認できるよう差入れていただきます（場合によっては、受入証拠金の額が最低維持証拠金を下回らない場合にも、追加証拠金を差入れていただくことがあります。）

追加証拠金を差入れていただけない場合は、また、差入れ後に証拠金への振替が行われていない場合は、「先物・オプション取引口座設定約諾書」等の規定に従い、追加証拠金発生日の翌々取引日以降に、当社の任意で、かつお客様の計算により、建玉の全てを決済し損失等に充当することといたします。また、損失の額が預託証拠金の額を上回った場合には、お客様はただちに不足金額（債務）をお支払いただくものとします。
なお、当該建玉に係る損金の受渡しが完了後、原則として当社の任意で先物・オプション口座の閉鎖を行います。

システム利用料

本システム利用料はありません。

口座管理料手数料

口座管理料手数料は無料です。

立会時間

立会時間は取扱商品により異なりますので、ホームページにおいて詳細を提示するものとします。

決済の方法

日経２２５先物および日経２２５先物ミニ取引

転売または買戻しによる決済（反対売買による決済）、もしくは特別清算指数（SQ 値）による決済（最終決済）

※SQ 値による決済の場合は、決済日当日まで建玉に対する必要証拠金が拘束されます。

日経２２５オプション取引

転売または買戻しによる決済（反対売買による決済）、もしくは権利行使による決済

※権利行使による決済の場合は、決済日当日まで建玉に対する必要証拠金が拘束されます。

手数料の徴収方法

取引の都度計算し、受渡代金に含めて徴収します。

取引概要の変更

当該概要書記載の内容は、都度変更される場合があります。変更の内容は、「証券オンライン指数先物および指数オプション取引取扱規程」等において定める方法により行い、お客様は変更内容について都度確認するものとします。

（2022 年 8 月 29 日現在）

証券オンライン指数先物および指数オプション取引取扱規程

（規程の趣旨）
第１条
１．この規程は、お客様が当社の証券オンライン取引システム（以下、「本システム」といいます。）を利用して行う指数先物取引（以下、「先物取引」といいます。）および指数オプション取引（以下、「オプション取引」といいます。）に関する取り決めです。
２．本規程に特段の定めのない事項は、証券オンライン取引総合取引約款および証券オンライン取引取扱規程によるものとします。

（口座開設基準）
第２条
１．本システムを利用して先物取引およびオプション取引を行う指数先物・オプション取引口座（以下、「先物オプション取引口座」といいます。）を開設することができるお客様は、当社が別に定める条件を全て満たし、かつ当社の定める方法による開設申込および審査を受けているお客様とします。
２．前項に定める当社が行う審査の結果、前項の条件に係わらず、適合性の原則に照らし、口座開設の可否を判断する場合があります。なお、その判断の理由は開示していません。

（建玉の上限数量）
第３条
本システムを利用して行う先物取引およびオプション取引の建玉の上限数量は、当社が別に定めるものとします。

（注文の上限数量）
第４条
本システムを利用して行う先物取引およびオプション取引の一注文あたりの発注可能数量の上限は、当社が別に定めるものとします。

（証拠金額）
第５条
１．本システムを利用して行う先物取引の建玉１単位あたりの証拠金額は、株式会社日本証券クリアリング機構より発表されるSPAN®証拠金額（以下、「SPAN証拠金」といいます。）に当社の定める割合を乗じた額（以下、「必要証拠金額」といいます。）とします。ただし、相場の大幅な変動などがある場合は、臨時に当社の判断により、当社の定める割合を引き上げ、必要証拠金の額を引き上げる場合があります。
２．オプション取引の売建玉１単位あたりの証拠金額は、前項に定められた金額に、お客様のオプション取引の建玉に対する価値の総額を加えた額とします。
３．この条に定める証拠金は、現金のみとします。

（証拠金所要額の計算）
第６条
証拠金所要額の計算は、株式会社日本証券クリアリング機構が定める SPAN 証拠金額に基づき、お客様の先物取引およびオプション取引の全建玉の状況に基づき、当社が別に定める方法により行います。

（受入証拠金の計算）
第７条
受入証拠金は、お客様の差し入れている証拠金額に取引終了時の先物建玉の終値（最終気配値のある場合はその気配値）を基準として計算した結果の評価損益を加算あるいは減算した額とします。

（証拠金等の前受け）
第８条
１．お客様は、本システムを利用して先物取引およびオプション取引を行うにあたり、先物取引における新規建あるいはオプション取引における新規売付を行う場合は、当社が別に定める方法により計算する必要証拠金額を、注文に先立って差し入れるものとします。
２．お客様は本システムを利用してオプション取引を行うにあたり、新規買付を行う場合は、買付代金相当額を注文に先立って差し入れるものとします。
３．第１項および第２項の定めに関わらず、お客様が新規に建玉を行う場合、新規建玉に係る取引手数料および消費税は、約定時に徴収するものとし、注文発注時には必要証拠金額の計算には含まないものとします。したがって、新規建玉注文が約定した際に、必要証拠金額が受入証拠金額を上回ることがあります。

（証拠金の維持）
第９条
１．お客様の受入証拠金が証拠金所要額を下回った場合、お客様は下回った日の翌営業日の当社が定める時限までに証拠金所要額を上回るに足る追加証拠金を現金にて当社に差し入れるものとします。
２．前項に定める時限は、お客様が当社へ入金を行い、前項に定める追加証拠金額以上の金額を、第１０条に定める方法により先物取引およびオプション取引の証拠金へ振替を行い、当社がその振替を確認した時点においてのみ満了するものとします。

（振替）
第１０条
１．前条の定めに関わらず、お預り金または委託保証金その他取引証拠金等から先物取引およびオプション取引の証拠金への振替が可能な場合は、お客様は差し入れ時限までに、お客様により振替指示を行うものとします。
２．前項に定めるお客様からの振替指示がない場合、当社は当社の判断により、お客様の計算において振替が可能な額の範囲内において振替を行う場合があります。
３．第９条に定める方法により追加証拠金額以上の入金および振替が当社にて確認でき

ない場合、新規建および証拠金から預り金への振替を制限させていただくことがあります。

（強制決済および注文取消）
第１１条
１．第９条に定める追加証拠金の差し入れが、当社の定める時限までに行われなかった場合、当社はお客様に事前に通知することなく、お客様の先物オプション取引口座における全ての建玉を、追加証拠金発生日の翌々取引日以降に、当社の任意の方法かつお客様の計算により反対売買により決済します。
２．当社が、前項に定める強制決済を行うに際し、お客様が強制決済実行前に発注した注文、あるいは当社の強制決済注文に対し訂正もしくは取消を行う目的において発注した注文は、全て強制決済注文に対し劣後するものとし、当社は、強制決済実行時もしくは実行後において、これらお客様が発注した強制決済に劣後する注文を、訂正あるいは取り消すことにより、強制的に失効することができるものとします。
３．第１項に定める強制決済の結果、当社に対する債務が発生した場合、お客様は速やかに残債務の弁済を行うものとする。

（特別清算指数による決済）
第１２条
１．お客様の先物オプション取引口座において、取引最終日を過ぎた未決済建玉がある場合は、当社は特別清算指数（SQ 値）に基づき、当社の定める方法により、これら未決済建玉の全てを決済します。
２．前項に定める特別清算指数による決済が行われた場合、お客様は当社に対し所定の手数料を支払うものとします。
３．前項の結果、当社に対する債務が発生した場合、お客様は速やかに残債務の弁済を行うものとする。

（不足金）
第１３条
１．先物取引もしくはオプション取引の損失の受渡日において、預託証拠金からの振替不足による不足金が生じた場合、お客様は当該不足金を受渡日当日中に現金により入金するものとします。ただし、当該受渡日においてお客様からの当該不足金の入金が確認できない場合、当社はお客様へ事前に通知することなく、お客様の当社における他の取引に係る委託保証金等預託現金額のうち、その取引毎に定められた引出可能額の範囲において、不足金に充当することができるものとします。
２．前項の結果、不足金全てを充当するに足りず、当社に対する債務が発生した場合、当社はお客様へ事前通知することなく、証券取引口座を凍結し、お客様の先物取引もしくはオプション取引に係る建玉を、当社の任意でお客様の計算により決済あるいは売却し、不足金に充当することができるものとします。
３．当社が、前項に伴う強制決済または売却を行うに際し、お客様が強制決済または売却実行前に発注した注文、あるいは当社の強制決済または売却注文に対し訂正もしくは取消を行う目的において発注した注文は、全て強制決済または売却注文に対し劣後するものとし、当社は、強制決済または売却実行時もしくは実行後において、

これらお客様が発注した強制決済または売却注文に劣後する注文を、訂正あるいは取り消すことにより、強制的に失効することができるものとします。

４．第２項の決済あるいは売却の結果、当社に対する債務が発生した場合は、お客様は速やかに残債務の弁済を行うものとします。

５．第１項における不足金の額について、お客様は、当該不足金が生じた場合には、その金額をNEOTRADE W（取引ツール）の画面にて確認するものとします。

（お客様死亡時の建玉の取扱）

第１４条

１．お客様の死亡が公的証明書類にて確認できた場合、当社はお客様へ事前に通知することなく、証券取引口座を凍結し、お客様の全ての先物取引もしくはオプション取引に係る建玉を、当社の任意でお客様の計算により返済することができるものとします。

２．当社が、前項に定める強制決済を行うに際し、お客様が強制決済実行前に発注した注文、あるいは当社の強制決済注文に対し訂正もしくは取消を行う目的において発注した注文は、全て強制決済注文に対し劣後するものとし、当社は、強制決済実行時もしくは実行後において、これらお客様が発注した強制決済に劣後する注文を、訂正あるいは取り消すことにより、強制的に失効することができるものとします。

（通知）

第１５条

当社は、第９条に定める追加証拠金の額および解消時限を、NEOTRADE W（取引ツール）の画面にて通知するものとします。

（再審査）

第１６条

お客様の先物オプション取引口座における取引について、相当期間取引がないと当社が認めた場合、当社は、お客様の先物オプション取引口座を凍結する場合があります。なお、この場合、当社はお客様が先物取引もしくはオプション取引を再開する際に、再審査を行うことがあります。

（先物およびオプション取引利用の停止）

第１７条

１．お客様が、この規程に定める内容あるいは法令・諸規則、証券オンライン取引総合取引約款に違反した場合、もしくはその他やむを得ない事由が生じた場合に、当社は直ちにお客様の本システムの利用を停止し、先物オプション取引口座の閉鎖をすることができるものとします。

２．当社が前項の定めに基づき、お客様の本システムの利用を停止し、先物オプション取引口座の閉鎖を行った場合、原則お客様が再度当社において先物オプション取引口座の開設を行うことはできないものとします。

３．第１項の場合、お客様は、当社からの事前通知がなくとも当社に対する先物取引およびオプション取引に係る債務について、当然に期限の利益を喪失し、速やかに残債務の弁済を行うものとします。

（差引計算）
第１７条の２
１．お客様は、期限の到来、期限の利益の喪失、その他の事由によってお客様が当社に対する債務を履行しなければならない場合、当社が、当社の判断によって当該債務とお客様の当社に対する債権とを、その期限の如何にかかわらず、また、お客様に事前に通知することなくいつでも相殺することができるものとします。
２．前項の相殺における債権債務の利息、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、債権債務の利息については当社の定める料率によるものとします。
３．お客様は、第１項の相殺における債権債務の支払通貨が異なるときに適用する為替レートを、当社が妥当と判断する実勢の為替レートを適用するものとします。

（充当の指定）
第１７条の３
お客様が当社に対する債務の弁済を行ない、または前条の差引計算を行なう場合において、お客様の弁済額、またはお客様の当社に対する債権がお客様の債務の全額を弁済させるのに足りないときは、お客様が当社に対して有する一切の債権につき、当社が適当と認める順序方法により弁済充当することができるものとします。

（取引細則の開示）
第１８条
当社は、この規程に定める他、金融商品取引法に基づく契約締結前交付書面等においてその内容を開示するものとします。

（規程の変更）
第１９条
この規程は、法令の変更又は監督官庁の指示、その他必要が生じたときには民法第５４８条の４の規定に基づき変更されることがあります。変更を行う旨および変更後の規定の内容並びにその効力発生時期は、効力発生時期が到来するまでにインターネットまたはその他相当の方法により周知するものとします。

附　　則

この規程は、平成２２年３月１日より施行する。

この改定規程は、平成２２年３月２５日より施行する。

この改定規程は、平成２２年７月２０日より施行する。

この改定規程は、平成２２年１２月１６日より施行する。

この改定規程は、平成２３年2月１４日より施行する。

この改定規程は、平成２３年7月３日より施行する。

この改定規程は、平成２４年9月３日より施行する。

この改定規程は、平成２５年１月１日より施行する。

この改定規程は、平成２５年７月１６日より施行する。

この改定規程は、平成２７年１月１日より施行する。

この改定規程は、平成２７年6月２２日より施行する。

この改定規程は、平成２８年4月１日より施行する。

この改定規程は、平成２８年７月１９日より施行する。

この改定規程は、平成２９年3月３１日より施行する。

この改定規程は、2021 年１月１日より施行する。

この改定規程は、2022 年８月 29 日より施行する。

指数先物・オプション取引の手数料・諸費用等

		手数料額（税込）
先物取引	日経２２５ラージ	２１０．１円
	日経２２５ミニ	３６．３円
オプション取引		約定代金×０.１５４％ 〔最低手数料：１１０円〕

※先物取引手数料については、１枚あたり・片道分の手数料になります。
※先物取引手数料総額は、１枚あたり手数料額×約定枚数で計算し、１円未満切り捨てとします。
※先物取引の SQ 値による最終決済についても、通常と同じ手数料が適用されます。

コール取引〔電話注文/その他取引（強制決済・注文取消・訂正等）〕

		手数料額（税込）
先物取引	日経２２５ラージ	1,１００円
	日経２２５ミニ	１１０円
オプション取引		約定代金×３.３０％ 〔最低手数料：３３０円〕
各種取引注文取消・訂正		１注文あたり2,２００円

※コール取引手数料は、電話での注文、日経 225 先物・オプション取引に係る追証未入金による強制決済等に適用されます。
※先物取引手数料については、１枚あたり・片道分の手数料になります。
※各種取引注文取消・訂正に係る手数料は、お客様がオンラインにて発注された注文を当社へ電話で取消または訂正する場合に適用されます。
※各種取引注文取消・訂正に係る手数料は、一口計算は行わず、注文の件数毎に課金します。

その他ご負担いただく手数料等

送金手数料 （※お客様が当社に入金する際の振込手数料）	各金融機関の定める額 ※クイック入金をご利用の場合は無料となります。　注１）
口座管理料	無 料
各種証明書等発行手数料　注２）	１,１００円（税込）/証明書１種類につき
各種帳票の写し　注３）	１,１００円（税込）/請求開始月を含む１２ヵ月分以内 ※以降１２ヵ月以内ごとに１,１００円（税込）ずつ増額

注１）ただし、お客様が証券総合取引によらない過度な入出金を繰り返し行っていると当社が判断した場合には、当社は、過去にさかのぼり入金および出金時の振込手数料をお客様に請求いたします。
注２）残高証明書/受渡証明書/特定口座年間取引報告書（再交付）/取引報告書（再交付）等を含みます。
注３）顧客勘定元帳等を含みます。
注４）各種証明書・帳票等の再発行等は、所定の手数料をお手続きの実行前にいただきます。証券総合口座に所定の手数料相当額以上の金銭残高があり、かつ出金可能額の範囲内である場合は、この金額から手数料相当額を充当いたします。

（2021 年４月１日現在）

当社の概要

商号等	株式会社 SBI ネオトレード証券 金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第８号
本店所在地	〒１０６－６０２９　東京都港区六本木一丁目６番１号
連絡先	０１２０（４４１）２５０（証券カスタマーサポート） ０５７０（５５０）２９０（携帯からはこちら）
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 一般社団法人　日本金融サービス仲介業協会 日本商品先物取引協会
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	3,600,086,116 円（2022 年４月５日現在）
主な事業	金融商品取引業
設立年月日	昭和２３年４月２２日

当社に対するご意見・苦情等に関するご連絡窓口

当社に対するご意見・苦情等に関しては、以下の窓口で承っております。
住所　　：〒１０６－６０２９　東京都港区六本木一丁目６番１号
電話番号：０１２０（４４１）２５０（証券カスタマーサポート）
　　０５７０（５５０）２９０（携帯からはこちら）
受付時間：月曜日～金曜日　８時００分～１７時００分（祝日を除く）

金融 ADR 制度のご案内

金融 ADR 制度とは、お客様と金融機関との紛争・トラブルについて、裁判手続き以外の方法で簡易・迅速な解決を目指す制度です。
金融商品取引業等業務に関する苦情及び紛争・トラブルの解決措置として、金融商品取引法上の指定紛争解決機関である「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（FINMAC）」を利用することができます。
住所　　：〒103-0025 東京都中央区日本橋茅場町二丁目１番１号　第二証券会館
電話番号：0120-64-5005　（FINMAC は公的な第三者機関であり、当社の関連法人ではありません。）
受付時間：月曜日～金曜日　９時００分～１７時００分（祝日を除く）

※この書面は、金融商品取引法第３７条の３の規定によりお渡しする書面です。

（2023 年 10 月 28 日現在）