

## 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、お取引店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)機関における苦情処理・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きをいいます。

安藤証券

商号等/安藤証券株式会社 東海財務局長(金商)第1号 加入協会/日本証券業協会、(社)金融先物取引業協会

## 海外証券先物取引の契約締結前交付書面

(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ものです。)

この書面には、当社のインターネット取引システム（以下、「美らネット24」と言います。）を通じて海外証券先物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。

- 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。
- 海外証券先物取引とは、外国金融商品取引所に上場している指数先物取引、国債先物取引をいいます。
- 指数先物取引は、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（SQ値）の差額を受払いすることで、差金決済が行われます。
- 海外証券先物取引は、お客様の注文を外国金融商品取引所の清算会員への取次ぎを通じて海外の市場に発注することによって取引される指数先物取引ですが、証拠金及び建玉は外国金融商品取引所が指定する建通貨となります。
- 海外証券先物取引は、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

#### 1. 取引手数料について

- ・ 海外証券先物取引を行うにあたっては、別紙「安藤証券 取引サービス別売買手数料・コスト一覧表」

[http://www.ando-sec.co.jp/pdf/commission\\_churanet.pdf](http://www.ando-sec.co.jp/pdf/commission_churanet.pdf) に記載の額及び方法により取引手数料をいただきます。

- ・ 海外証券先物取引を行うにあたっては、別紙「安藤証券 取引サービス別売買手数料・コスト一覧表」

[http://www.ando-sec.co.jp/pdf/commission\\_churanet.pdf](http://www.ando-sec.co.jp/pdf/commission_churanet.pdf) に記載の額及び

方法により休眠口座維持手数料を頂く場合がございます。

## 2. 証拠金について

- ・ 海外証券先物取引を行うにあたっては、別紙「安藤証券・取引サービス別売買手数料・コスト一覧表」[http://www.ando-sec.co.jp/pdf/commission\\_churanet.pdf](http://www.ando-sec.co.jp/pdf/commission_churanet.pdf)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、当社が指定する外国金融商品取引所がSPAN<sup>®</sup>に基づいて、先物取引の建玉から生じるリスクに応じて計算される新規建て必要証拠金（イニシャル・マージン）に、当社所定の掛け目を乗じた金額になりますので、海外証券先物取引の建玉金額に係る必要証拠金額に対する比率は、常に一定ではありません。

※ SPAN<sup>®</sup>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。

### 海外証券先物取引のリスクについて

1. 海外証券先物の価格は、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、海外証券先物取引は、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、海外証券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、その損失は証拠金の額だけに限定されません。

・ 海外証券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となります。

- ・ 海外証券先物取引は、指定建通貨毎の証拠金管理を行う場合、円建て証拠金と外貨建て証拠金を当社が定める外国為替レートで振り替える取引が発生します。したがって、外国為替市場の急激な変動や、当社が定める外国為替レートの設定に含まれる実質的なコストにより、お客様が想定した外国為替レートで振り替えができないことがあります。

- ・外国金融商品取引所は、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、証拠金の追加差入れ又は追加預託や代用有価証券と現金の差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、外国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。
- ・外国金融商品取引所が存在する国の政治・経済の動向、法規制の変更などが不測の影響を与えることがあります。
- ・寄付きや引けにおける板寄せ方式が存在しないこと、取引時間開始前の「取消・訂正不能時間」の存在、注文における新規と返済の区別が存在しないこと、逆指値注文などのように、同じような注文方法であっても市場毎に要件が異なることなど、海外市場の取引慣習に十分に精通していないと、意図した通りに注文が発注できず、不測の損失を被る可能性があります。

2. 海外証券先物取引においてお客様が当社に預託した証拠金は、すべて日証金信託銀行の信託口座に預託し、当社の資金とは別に管理しておりますが、投資者保護基金による補償の対象にはなりません。

ここでは、海外証券先物取引に伴う典型的なリスクを簡潔に説明するためのものであり、お取引に生じる一切のリスクを漏れなく示すものではありません。お取引の開始に際しては、取引の仕組みおよびリスクについて十分にご研究頂くようお願い申し上げます。

#### **海外証券先物取引は、クーリング・オフの対象にはなりません**

- ・海外証券先物取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定の適用はありません。

## 海外証券先物取引の仕組みについて

### 1. 海外証券先物取引の仕組みについて

#### ○ 取引の方法

##### (1) 対象指数

取引対象の株価指数は、次のとおりです（〈 〉内は上場している取引所）。

##### a. 日経平均株価指数（円建て）

〈シンガポール取引所。以下、「SGX」又は「SGX 市場」と言います。〉〈シカゴ商業取引所。以下、「CME」又は「CME 市場」と言います。〉

##### b. ダウ工業株 30 種平均株価指数（米ドル建て）〈シカゴ商品取引所。以下、「CBOT」又は「CBOT 市場」と言います。〉

##### (2) 当社お取扱い限月

SGX 市場、CME 市場、CBOT 市場とともに、3、6、9、12 月のサイクルで期近の当社所定の限月を取り扱います。

##### (3) 呼び値（ティック）及び取引単位

##### a. 日経平均株価指数先物取引（円建て）

呼び値は、1 ティック当たり 5 円です。

SGX 市場、CME 市場とも、「建玉 1 枚当たり、500 円×日経平均先物価格」です。例えば、1 ティックで決済した場合、建玉 1 枚当たり 2500 円になります。

##### b. E-Mini DOW（5 \$）株価指数先物取引（米ドル建て）

呼び値は、1 ティック当たり 1 ポイントです。

「建玉 1 枚当たり、5 米ドル×E-Mini DOW（5 \$）先物価格」です。例えば、1 ティックで決済した場合、建玉 1 枚当たり 5.00 米ドルになります。

##### (4) 限月間スプレッド取引

当社は、海外証券先物取引における限月間スプレッド取引（二つの限月取引のうち一方の限月取引の売付けと他方の限月取引の買付けを同時に行う取引）をお取扱いいたしません。

##### (5) 取引の期限

##### a. 日経平均株価指数先物取引（円建て）

当社が取り扱う海外市場日経平均株価先物取引（円建て）は、3月、6月、9月、12月の各月の第二金曜日の前営業日に終了する取引日（日本時間午後4時15分に取引開始するSGX夜間取引から翌営業日のSGX日中取引の終了時までの1サイクルをいいます。）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、SGX市場及びCME市場の新しい限月取引は、直近の限月取引の取引最終日に対して、その翌日のSGX市場日中取引開始時（日本時間午前8時45分）から開始されます。

b. E-Mini DOW（5\$）株価指数先物取引（米ドル建て）

当社が取り扱うE-Mini DOW（5\$）株価指数先物取引は、3月、6月、9月、12月の各月の第3金曜日の日本時間午後11時30分（夏時間は午後10時30分）を取引最終日時とします。

(6) 当社取扱い取引時間

a. 日経平均株価指数先物取引（円建て）

<SGX市場の日中取引>

SGX市場の日経平均株価指数先物取引（円建て）は、国内営業日の日本時間午前8時45分から午後3時30分までの間、日中取引が行われます。

<SGX市場の夜間取引>

SGX市場の日経平均株価指数先物取引（円建て）では、国内営業日の日本時間午後4時15分から取引所が定める時刻までの間、夜間取引が行われます。SGX市場の夜間取引における建玉は、翌国内営業日を取引日とする建玉になります。

<CME市場の取引>

CME市場の日経平均株価先物取引（円建て）は、CMEが定める取引休業日を除き、平日の日本時間午後4時15分までの当社所定の時間から翌日午前6時15分（3月の第2日曜日から3月の第2日曜日までの夏時間）、又は、7時15分（11月の第1日曜日から3月の第2日曜日までの冬時間）までの間に行われます。ただし、日本時間午前5時15分から5時30分まで（夏時間）、又は、午前6時15分から6時30分まで（冬時間）の15分間は、ご注文のみ可能であり約定は行われません。

CME市場の取引における建玉は、同市場の取引時間終了後に最も早く取引されるSGX市場の日中取引を基準とした国内営業日を取引日とする建玉になります。

b. E-Mini DOW（5\$）株価指数先物取引（米ドル建て）

米国現地取引日の日本時間午前8時（夏時間は午前7時）から翌現地取引日の日本時間午前7時15分（夏時間は午前6時15分）です。ただし、日本時間午前6時15分から6時30分まで（夏時間は午前5時15分から5時30分まで）の15分間は、ご注文のみ可能であり約定は行われません。

(7) 取引可能日

a. 日経平均株価指数先物取引（円建て）

<SGX市場の日中取引>

原則として国内営業日に取引を行います。

<SGX市場の夜間取引>

原則として国内営業日に取引を行います。但し、国内営業日であっても、取引所が定める日については、夜間取引が休業となる場合があります。

## <CME市場の取引>

国内営業日であるか否かにかかわらず、CMEが定める取引休業日以外の平日に取引を行います。

### b. E-Mini DOW (5 \$) 株価指数先物取引 (米ドル建て)

上記の a. 日経平均株価指数先物取引<CME市場の取引>に準じた取引可能日となります。

## (8) 注文の種類

### a. 日経平均株価指数先物取引 (円建て)

- ・ SGX市場、CME市場とも、指値注文 (リミット・オーダー) 及び逆指値注文 (ストップ・リミット・オーダー) を利用できます。成行注文 (マーケット・オーダー)、及び、注文単価を成行きにした逆指値注文 (ストップ・オーダー) は当社では利用できません。
- ・ 「執行条件」 (寄り付き限定、大引け限定など) を設定することはできません。
- ・ 新規建注文と決済 (返済) 注文の区分はありません。
- ・ 逆指値注文では、買い注文の時は最も直近の時価を超える価格で、売り注文の時は最も直近の時価未満の価格についてのみ、「トリガー単価」を設定できます。尚、SGX市場とCME市場では仕様が異なり、各取引所が定める仕様に従います。

### b. E-Mini DOW (5 \$) 株価指数先物取引 (米ドル建て)

上記の a. 日経平均株価指数先物取引の CME 市場と同様の仕様です。

## (9) 注文の有効期限

### a. 日経平均株価指数先物取引 (円建て)

SGX市場の日中取引、夜間取引、及び、CME市場の各セッション毎に注文の期限が到来します。各セッションを跨いで注文を繰り越すことはできません。

### b. E-Mini DOW (5 \$) 株価指数先物取引 (米ドル建て)

CBOT市場の各セッション毎に注文の期限が到来します。各セッションを跨いで注文を繰り越すことはできません。

## (10) 注文の取消・訂正

- ・ お客様が発注された注文は、未約定の場合には取消又は訂正を行うことができます。訂正については、指値の訂正のみ可能です。数量 (枚数) の訂正はできませんので、数量を訂正したい場合は、注文を取消した後に新たに注文を発注する必要があります。
- ・ 取引開始時間直前に注文の取消・訂正を行うことによる不公正な取引を防止する観点から、SGX市場については、取引開始時間直前または取引時間終了直前に、取消・訂正不能時間 (ノー・キャンセレーション・ピリオド) があります。

## (11) 注文の失効

有効期限内の注文でも、以下の場合は失効となります。失効になった注文に係る新規建て余力の拘束は、取引所から失効の連絡を受けた後に回復し、他の注文の新規建て余力として利用することが出来ます。

- ・ 証拠金不足になった場合

- ・ 逆指値注文で市場（取引所）が定める発注の要件又は発注可能時間に沿わない場合
- ・ お客様全体の建玉状況が一定の限度を超えてしまった場合
- ・ CME 市場及び CBOT 市場において、発注価格の誤入力を防止するために、直近の時価（時価が無い場合は、取引所が定める「参照値」）に対して一定の価格帯の外側の価格で注文が発注された場合。
- ・ 「取消・訂正不能時間」に発注した場合

#### (12) 一注文あたりの発注上限、及び、建玉限度

発注限度は、一注文当たり 200 枚までです。総建玉枚数の上限は、お客様毎に、1 顧客当たり、建通貨毎に、最大で 200 枚ですが、当社はお客様毎に異なる上限を設定できるものとします。建玉限度は当社が任意に変更する場合があります。

#### (13) 制限値幅及び取引の一時中断

##### a. 日経平均株価指数先物取引（円建て）

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（原則として、SGX 市場及び CME 市場における各々の前日の清算数値。）から、各市場ごとに制限値幅を設けています。（但し、取引所の定めにより、異なる取扱いを行う場合があります。）

##### ① SGX 市場

###### <値幅制限>

前日の SGX 市場の清算数値から上下 2,000 円が制限値幅になります。

###### <サーキットブレーカー>

###### （第一次価格制限）

当限の基準値が 7,000 円未満の場合に、当限のビッドまたはオファー価格が基準値の上下 1,000 円に達した場合は、10 分間の調整時間を経た上で基準値の上下 1,500 円が有効となります。

###### （第二次価格制限）

当限の基準値が 10,000 円未満の場合に、当限のビッドまたはオファー価格が基準値の上下 1,500 円に達したときは、更に 10 分間の調整時間を経た上で値幅制限上限・下限が有効となります。

##### ② CME 市場

###### <値幅制限>

前日の CME 市場の日経平均株価指数先物取引（円建て）の清算数値が、(i) 20,000 円以下であれば、同清算数値から上下 1000 円、(ii) 20,005 円以上 30,000 円以下であれば、同清算数値から上下 1500 円、(iii) 30,005 円以上であれば、同清算数値から上下 2,000 円が制限値幅になります。

##### b. E-Mini DOW（5 \$）株価指数先物取引（米ドル建て）

- ① 通常取引時間帯（日本時間 23 時 30 分～翌日午前 7 時 15 分。但し、夏時間は 22 時 30 分～翌日午前 6 時 15 分）

< 値幅制限 >

値幅上限は無し。値幅最大下限は基準値の-30%相当値。

< サーキットブレーカー >

(第一次価格制限)

当限のオファー価格が基準値の-10%相当値を下回った場合は、10分間の調整時間を経た上で基準値の-20%相当値が有効となります。

(第二次価格制限)

当限のオファー価格が基準値の-20%相当値を下回った場合は、更に10分間の調整時間を経た上で値幅最大下限(-30%相当値)が有効となります。

- ② 電子取引のみ時間帯（日本時間午前8時00分～23時30分。但し、夏時間は午前7時00分～22時30分）

< 値幅制限 >

値幅上限は基準値の+5%相当値。値幅下限は基準値の-5%相当値。

< サーキットブレーカー >

通常取引時間開始15分前以降に規制が掛かったままの場合、取引が中断される場合があります。

(14) 取引規制

外国金融商品取引所、又は、同取引所の清算会員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、当社もそれに応じた規制措置を取ることがあります。

- 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. 先物取引の制限又は禁止
- e. 建玉制限

○ 清算及び決済の方法

- (1) 日経平均株価指数先物取引（円建て）におけるCME市場からSGX市場への建玉自動移管

SGXとCMEとの間の協定により、両市場に上場している日経平均株価指数先物取引（円建て）におけるお互いの建玉を相手側の市場に移管することが認められています。（相互決済システム。Mutual Offsetting System（MOS）と言います。）

当社では、CME市場の建玉はすべて自動的にSGX市場に移管して、SGX市場の先物取引証拠金（円建て）の中で決済を行います。

- (2) 同一限月売り買い両建玉の即時相殺（ネッティング）

当社の海外証券先物取引では、同一限月の同一先物取引の建玉であれば、約定時にリアルタイムで

相殺（ネッティング）し、売り買いの枚数を差し引いて建玉の方向（売り新規又は買い新規）及び建玉枚数が決まります。

但し、異限月の売り買い両建て取引についてはネッティング（相殺）は行われず、合算した枚数を建玉枚数といたします。

(3) 転売又は買戻しによる決済（反対売買による決済）

海外証券先物取引について、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。

(4) 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。最終清算数値とは以下の数値を言います。

a. 日経平均株価指数先物取引（円建て）

大阪証券取引所に上場している日経平均株価指数先物取引の国内取引最終日の翌日の株価指数対象各銘柄の始値に基づいて算出する特別な指数。SQ 値と言います。

b. E-Mini DOW（5 \$）株価指数先物取引（米ドル建て）

ニューヨーク証券取引所（NYSE）又はナスダック（NASDAQ）市場に上場しているダウ工業株平均株価を構成する各現物株の現物市場での始値から算出される特別な指数。SQ 値と言います。

(5) 決済の優先順位

当社の海外証券先物取引では、お客様が建玉の新規及び決済を指定することはできません。あらかじめ当社が定める決済の優先順位に応じて、自動的に新規の売付け、新規の買付け、転売（売り決済）又は買戻し（買い決済）の別及び組合せが定められるものとします。

決済の優先順位は、次のとおりです。

- ① 決済を行う外国金融商品取引所の取引日（現地約定日）が古い順（先入れ・先出し）
- ② 上記①の取引日が同一の場合は、利益が出やすい順（買い建玉は約定単価の小さい順、売り建玉は約定単価の大きい順）
- ③ 上記①及び②が同一の場合は、元注文の一部について約定時間が古い順

(6) 決済期日・受渡日

海外証券先物取引についてお客様が転売又は買戻しを行った場合、又は、SQによる最終差金決済が行われた場合において、利益又は損失が生じた場合は、当該利益又は損失に相当する額を、当該転売又は買戻しに係る国内約定日から起算して4営業日目に、お客様の海外証券先物取引口座における建通貨毎の証拠金総額から差し引くことで当社にお支払いいただきます。

但し、建玉の決済による損金及び諸経費相当額が受入証拠金の総額、又は、実質現金残高（受渡日

が到来済みの現金残高を言います。)の小さい方の額を上回った場合、当該不足金額を国内約定日の翌国内営業日の正午までに差入れ又は預託していただく必要があります。

## 2. 証拠金について

### (1) 証拠金の差入れ又は預託

証拠金は、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)又は現金の不足額(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)のいずれか大きな額以上の額を、不足額が生じた日の国内翌営業日の正午までに差入れ又は預託しなければなりません。

- ・ 当社では証拠金は有価証券による代用ができませんので、現金不足額に相当する額の証拠金だけでなく、総額の不足額に相当する証拠金についても、必ず円貨による現金で差入れ又は預託しなければなりません。
- ・ 当社では、お客様が新規建て注文を発注する場合には、発注に係る必要証拠金額を考慮した前受け制を条件としております。

\*受入証拠金は、同一建通貨の建玉・証拠金ごとに区分して管理します。従って、海外証券先物取引に係る受入証拠金と他の金融商品取引所に係る先物・オプション取引口座の受入証拠金を合算することはできません。

### A. 証拠金所要額

証拠金所要額は、「必要証拠金額」と「その他所要額」の合計額になります。

#### ① 必要証拠金額

- ・ 日経平均株価指数先物取引(円建て)の場合、「シンガポール取引所(SGX)所定のイニシャル・マージン(新規建て必要証拠金)の120%に建玉(未決済約定をいいます。)枚数を乗じた円金額」になります。
- ・ E-Mini DOW(5\$)株価指数先物取引(米ドル建て)の場合、「シカゴ商業取引所(CBOT)所定のイニシャルマージンの120%に建玉枚数を乗じた米ドル金額」になります。
- ・ 建玉枚数は、同一先物取引・同一限月の売り買い両建て取引について、リアルタイムで相殺し、差し引いて算定します。他方で、限月の異なる売り買い両建て取引については、相殺せず合算します。

#### ② その他所要額

日経平均株価指数先物取引(円建て)、E-Mini DOW(5\$)株価指数先物取引(米ドル建て)の取引毎に、指定建通貨により、下記のとおりです。

- ・ 「国内取引日当日(日中取引時間終了前)の決済損益(売買手数料は除きます。)」から「同決済取引に係る新規建玉について、直近の清算値で評価した計算上の損益額(同一国内取引日内での新規建て・決済取引の場合はゼロ)」を差し引いた額がマイナスの場合の当該マイナス額。
- ・ お客様の出金予約額

- ・ その他当社が必要と認める額

## B. 受入証拠金の総額

受入証拠金の総額は、日経平均株価指数先物取引（円建て）、E-Mini DOW(5\$) 株価指数先物取引（米ドル建て）の各取引毎に、「証拠金として差し入れ又は預託している金銭の額」±「お客様の現金授受予定額」によって、算定されます。受入証拠金総額は、受渡日を基準として当該受渡日に現金授受（受領又は支払）が完了済みか又は完了する予定である金額を言います。同一通貨の建玉・証拠金ごとに、同一の外国金融商品取引所の建玉ごとに計算します。

- お客様の現金授受（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）

±お客様との間で授受を終了していない先物取引の決済損益額

－お客様の負担すべきもので当社が必要と認める額

\* 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日（前取引日）の清算数値（海外証券先物取引については、前取引日の当社所定の外国金融商品取引所で定める清算指数）との差額に基づき算出されます。

\* 決済の約定済みで受渡日が未到来（値洗い終了時の翌国内営業日に受渡日が到来する決済損益については、受渡日が到来したものといたします。）の決済取引に係る決済利益額については、当社が別途定める場合を除き、受入証拠金総額から除外いたします。（証拠金余力に加算することができません。）

\* 「お客様の負担すべきもので当社が必要と認める額」は、「建玉に係る売買手数料」などを言います。

## C. 証拠金余力

指定建通貨毎に、上記「B. 受入証拠金総額」から上記「A. 証拠金所要額」を差し引いた金額が、「証拠金余力」になります。証拠金余力がマイナスのときは、建玉を減少させて証拠金余力をゼロ以上に回復させる注文のみ、発注が可能です。

## D. 追加証拠金の差し入れ又は預託

当社では、当社取扱い先物取引における指定建通貨の証拠金毎に、下記の通りといたします。

### a. 日経平均株価指数先物取引（円建て）について

国内営業日における日本時間午後 3 時 30 分に終了する日中取引終了時のお客様の海外証券先物取引口座に係る円証拠金の建玉について、当社所定の外国金融商品取引所で定める清算指数を以って値洗いします。

その結果、お客様の「B. 受入証拠金の総額」が「A. 証拠金所要額 ① 必要証拠金額」を下回った（証拠金余力不足額が発生した）場合、証拠金を追加で差し入れ又は預託していただく必要があります。

### b. E-Mini DOW(5\$) 株価指数先物取引（米ドル建て）について

国内営業日の翌日における取引終了時（日本時間午前7時15分（夏時間は午前6時15分））のお客様の海外証券先物取引口座に係る米ドル証拠金の建玉について、CBOT市場で定める清算指数を以って値洗いします。

外貨建て証拠金の場合、お客様の「B. 受入証拠金の総額」が「A. 証拠金所要額 ① 必要証拠金額」を下回った（証拠金余力不足額が発生した）ときは、お客様への追加証拠金の差入れ又は預託の請求についても、外貨建て証拠金に対して行います。

又、当社所定の外国金融商品取引所が発表する「イニシャル・マージン」の更新により、指定建通貨ごとに、お客様の受入証拠金総額が証拠金所要額を下回った場合にも、証拠金を追加で差入れ又は預託していただく必要があります。

当社から証拠金の差入れ又は預託の請求が行われた場合、追加証拠金発生日の翌国内営業日の正午までに、その差入れ又は預託をお客様が行わなければ、当社は、お客様の海外証券先物取引口座における全建通貨の全建玉についてお客様の計算で転売又は買戻しを行い、決済いたします。

#### E. 強制決済

追加証拠金発生日の翌国内営業日の日本時間正午までに、当社がお客様の追加証拠金差入れ又は預託を確認できなかった場合、当社の任意で、お客様の海外証券先物取引口座の全建玉を反対売買により、決済させていただきます。

\*追加証拠金の差入れ又は預託が確認できず、当社の任意でお客様の口座の全建玉を決済するに至ったときは、お客様の海外証券先物取引口座を停止あるいは解除させていただく場合があります。

\*当社の任意で反対売買を行う場合も、所定の売買手数料をいただきます。

#### F. 不足金、遅延損害金

海外証券先物取引の決済取引に係る受渡日は、原則として決済約定日から数えて4国内営業日目ですが、値洗いの結果、建玉の決済による損金及び諸経費相当額が受入証拠金総額、又は、実質現金残高（受渡日が到来済みの現金残高を言います。値洗い終了時の翌国内営業日に受渡日が到来する決済損益については、受渡日到来済みといたします。）の小さい方の額を上回った場合、当該不足金額を約定日の翌営業日の正午までに差入れ又は預託していただく必要があります。

不足金の入金が決済約定日の翌営業日の正午までに確認できなかったときは、当社の任意でお客様の海外証券先物取引口座に建玉が残っている場合には全建玉を反対売買により、決済させていただきます。

外貨建て証拠金に不足金が発生した場合は、「D. 追加証拠金の差入れ又は預託 ②E-Mini DOW(5\$) 株価指数先物取引（米ドル建て）について」と同様に扱います。

お客様から不足金のご入金が決済約定日から数えて4営業日目までにない場合は、当該不足金は未履行債務として取り扱われることとなります。当社は、履行期日の翌日より履行の日まで、年率14.6%の割合による遅延損害金を申し受けるものとします。

\*当社の任意でお客様の口座の全建玉を決済するに至ったときは、お客様の海外証券先物取引口座を停止あるいは解除させていただく場合があります。

\*当社の任意で反対売買を行う場合も、所定の売買手数料をいただきます。

#### G. お客様が当社に預託した証拠金の管理方法

- 当社名義の委託オムニバス口座による一括管理

海外証券先物取引では、約諾書の定めにより、お客様が差入れ又は預託した証拠金（お客様の証拠金口座への現金支払い予定額に相当する部分は除きます。）は、当社が任意にこれを他に貸し付け、担保に供し、他のお客様の海外証券先物取引に使用することができます。

当社の海外証券先物取引においても、外国金融商品取引所に係る清算機関、及び、当社がお客様の注文を取り次いでいる取引参加者（現地清算会員）に対して、当社名義の委託オムニバス口座（一の金融取引業者が別の金融取引業者にて保有する口座で、2人以上の個人口座の取引がこの種の口座にて複合されます。個人の口座所有者の名前等は当該別の金融取引業者には公開されません。）の中で一括して証拠金及び建玉を管理します。

- サブアカウント方式による建玉及び証拠金の区分管理の有無

当社では、当社取引先物取引毎に、以下の通りとします。

- a. 日経平均株価指数先物取引（円建て）

お客様の各口座は、SGX市場に係る清算機関の規則によって、お互いに同一限月の売り買い両建ての建玉を相殺することが禁止される「サブアカウント」として扱われますので、証拠金及び建玉は他のお客様とは区分して管理されます。

- b. E-Mini DOW（5\$）株価指数先物取引（米ドル建て）

現地取引所に対しては「サブアカウント」方式では管理しておりませんが、お客様の各口座について建玉枚数（各限月の売り買い差し引き枚数を合計した枚数）を算出し、すべてのお客様について合計した枚数を当社名義の委託オムニバス口座における建玉として管理しています。

- お客様の建玉及び証拠金と外国金融商品取引所との関係

お客様の建玉及び証拠金は、当社名義の委託オムニバス口座の中でサブアカウントとして区分管理されており、お客様の名義で現地清算会員及び外国金融商品取引所との間で直接管理されているものではありません。

#### (2) 計算上の利益の払出し

海外証券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、当社で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であっても、払出しを受けることができません。

#### (3) 証拠金の入金

- 円証拠金への入金

当社の海外証券先物取引口座の円証拠金へのご入金は、海外証券先物取引口座専用の指定銀行口座へのご入金によるものとしますが、お客様からお電話での申し出があり、当社が特に認める場合

はその限りではありません。

- 外貨建て証拠金への入金

当社の海外証券先物取引口座の外貨建て証拠金への入金を外貨で直接行うことはできません。円証拠金から外貨建て証拠金への振替によって行っていただきます。

#### (4) 証拠金の出金・返還

- 出金予約（円）

当社は、お客様が海外証券先物取引口座の円証拠金について、お客様が差入れ又は預託した受入証拠金総額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る際には、出金余力の範囲内で出金予約（円）をしていただきます。

外貨建て証拠金については、円証拠金に振り替えてから、払い出しを行っていただきます。

- 出金予約可能時間、及び、出金日

国内営業日の日本時間午後 3 時 30 分までに、出金予約（円）の指示を行っていただきますが、翌国内営業日のみ出金が可能です。翌々国内営業日以降の出金予約（円）はできません。

- 出金審査

SGX 市場の日中取引時間終了後、同市場の清算値でお客様の海外証券先物取引口座の円証拠金について建玉の値洗いをを行います。その結果、当社所定の出金余力がお客様の出金予約額を上回った場合のみ、証券総合口座を開設時にご登録いただいたお客様の銀行口座に、翌国内営業日の午前中に出金（円）を行います。

お客様の出金予約額（円）が当社所定の出金余力を下回った場合、予約金額の全額について出金できません。

- 出金余力

円証拠金における実質現金残高（受渡日が到来済みの現金残高を言います。値洗い終了時の翌国内営業日に受渡日が到来する決済損益については、受渡日到来済みといたします。）と円証拠金における証拠金余力（受入証拠金の総額から証拠金所要額を差し引いた額）のうち小さい方の額から、当社所定の拘束金を差し引きます。

更に、円証拠金における決済取引による利益、及び、決済取引に係る必要証拠金の減少額については、日計り取引による場合を除き、反対売買による決済、又は、最終決済に係る国内約定日から 3 国内営業日目までは返還できませんので、出金余力から拘束いたします。その上での残額が「出金余力」となります。

### 3. 当社又は指定清算参加者に支払不能等の事由が発生した場合の建玉の処理について

当社又は指定清算参加者に支払不能等の事由が発生した場合に執行取引所が支払不能等による売買停止等の措置を講ずる場合があります。その時にお客様が建玉を有している場合、執行取引所の規定に基づいて次のように取り扱います。ご注意ください。

- ① お客様の口座は、委託オムニバス口座を通じてお客様の口座を一括して一つの委託者とみなしているため、お客様の口座の建玉のみ単独で他の取引参加者に移管することはできません。

- ② 当社又は指定清算参加者に支払不能等の事由が発生した場合、お客様の計算により、建玉を決済していただきます。
- ③ 指定清算参加者の支払不能等による売買停止等の措置が講じられた場合は、他の清算参加者に当社委託オムニバス口座の移管が完了するまで、新規建て注文受付の停止、建玉決済の反対売買注文のみ受け付ける場合があります。
- ④ 指定清算参加者が指定する代理ブローカー（清算参加者）に支払不能等の事由が発生した場合にも売買停止等の措置が講じられる場合があります。

### **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。
- ・ 海外証券先物取引  
金融商品取引法第2条第23項に定める「外国市場デリバティブ取引」のうち、国債先物取引、国債先物オプション取引、株価指数先物取引、株価指数オプション取引及び株券オプション取引をいいます。
- ・ 海外証券先物取引口座  
海外の金融商品取引所で取引される「外国市場デリバティブ取引」の建玉及び証拠金を管理する口座をいいます。

### **海外証券先物取引に係る金融商品取引契約の概要**

当社における海外証券先物取引については、以下によります。

- ・ 海外証券先物取引の媒介、取次ぎ又は代理
- ・ 海外証券先物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**

## <海外の金融商品取引所で取引される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。

- ・ 海外証券先物取引に係る差金等決済から生じた利益は、国内の金融商品取引所で取引される指数先物取引に係る差金決済等から生じた利益と異なり、雑所得に係る総合課税の対象となります(申告分離課税の対象とはなりません)。同様に、損失が生じた場合には、国内の金融商品取引所で取引される指数先物取引に係る差金決済等から生じた損失と異なり、次年度以降に損失を繰り越せません。

法人のお客様に対する課税は、以下によります。

- ・ 海外証券先物取引に係る損益は、法人税に係る所得の計算上、益金の額又は損金の額に算入されます。

なお、詳細につきましては、お近くの税務署や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、当社において海外証券先物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海外証券先物取引口座の開設が必要ですが、そのためには、あらかじめ「美らネット 24 証券総合口座」の開設が必要です。美らネット 24 証券総合口座開設申込基準をよくお読みいただいた上で、同口座の開設をお願いします。
- ・ 海外証券先物取引口座開設の審査に合格されたお客様に対しまして、当社より「海外証券先物取引等口座設定約諾書」及び「確認書」をご郵送、又は、電磁的方法により専用取引画面上に交付いたします。必要事項をご記入のうえ、捺印して当社にご返送いただくか、又は、電磁的方法によりご同意いただくことが必要です。書類の郵送によるご同意の場合に限り、同約諾書には、所定の金額の収入印紙が必要になります。なお、約諾書については十分お読みください。
- ・ 海外証券先物取引に関する金銭・建玉は、すべて海外証券先物取引口座を通して処理されます。
- ・ 海外証券先物取引口座の開設にあたっては、一定の投資経験（株式又は上場投資信託等の投資経験は必ず必要です。）、知識、資力等が必要ですので、場合によっては、口座の開設に應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専用取引画面よりご入力していただきます。これらの事項をご入力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。
- ・ 当社の海外証券先物取引の注文では、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する必要はありません。あらかじめ当社が定める決済の優先順位に応じて、自動的に新規の売付け、新規の買付け、転売又は買戻しの別が定められるものとします。
- ・ 注文された海外証券先物取引が成立すると、その内容をご確認いただくため、当社から「取引報

告書」が電磁的方法により交付されます。海外証券先物取引口座の取引報告書は郵送による書面では交付いたしません。美らネット 24 海外証券先物専用取引画面にて、ご確認ください。

- ・ また、当社から毎月、「取引残高報告書」が交付されます。これは、海外証券先物取引が成立した後、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のものです。美らネット 24 海外証券先物取引口座の取引残高報告書は郵送による書面では交付いたしません。本取引残高報告書は電磁的方法により交付されます。美らネット 24 海外証券先物専用取引画面にて、ご確認ください。（同取引残高報告書は、「先物取引に関する通知書」や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、「照合通知書」の内容を含みます。）
- ・ この「取引報告書」、「取引残高報告書」（「先物取引に関する通知書」及び「照合通知書」を含みます。）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、速やかに当社の管理責任者へ直接ご連絡下さい。  
本店 管理部 Tel 052-971-7024  
美らネット 24 サポートセンター Tel 0120-024-005（受付時間：平日 8 時～19 時）

## 当社の概要

商号等	安藤証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長（金商）第 1 号
本店所在地	〒460-8619	愛知県名古屋市中区錦 3 丁目 23 番 21 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		
当社が契約する特定第一種金融商品取引業務に係る指定紛争解決機関	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	22 億 8 千万円		
主な事業	金融商品取引業		
設立年月	昭和 19 年 4 月		

※ 連絡先は、美らネット 24 サポートセンター（TEL: 0120-024-005、受付時間：平日の 8 時～19 時）です。

平成 25 年 4 月

僕もFX取引で  
困ってるんだ。  
どうしよう…。

投資信託の取引で  
困ったわ。どうしたら  
いいかしら。

株取引のトラブル、  
どこに聞けば  
いいんだろう？



ご相談は、「指定紛争解決機関」

## 証券・金融商品あっせん相談センター

フィンマック  
証券・金融商品あっせん相談センター(ADR FINMAC)は、  
法律に基づく公的な団体が連携した紛争解決機関です。2011年4月、**特定第一種金融商品取引業務  
に係る指定紛争解決機関(金融庁指定)**としての業務を開始しました。

証券会社・銀行等が販売する株や投資信託、FX等のトラブルを**公正・中立な立場で解決**を目指します。

株式・投資信託・債券・外国為替証拠金取引(FX)・証券投資顧問業など、さまざまなご相談・苦情を受け付けます(預金、保険、商品先物取引などの相談・苦情や投資相談、税務相談はお受けしていません。)公正・中立な立場の弁護士が行う紛争解決あっせん手続きの申立てを受け付けます(あっせんは、損害賠償請求額に応じ2千円から5万円をご負担していただきます。)

詳しくはホームページへ <http://www.finmac.or.jp> FINMAC 検索



ご相談は  
お気軽に!



フリーダイヤル

**0120-64-5005**

●月曜日～金曜日(祝日等を除く) ●午前9時～午後5時



**03-3669-9833**



ADR FINMAC

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



かいけつサポート

指定紛争解決サービス

〒103-0025

東京都中央区日本橋茅場町 2-1-13 第三証券会館



## FINMAC(フィンマック)とは?

法律に基づく公的な団体が連携した新たな苦情・紛争解決機関です。株式・投資信託・債券・外国為替証拠金取引(FX)・証券投資顧問業などに関するさまざまなご相談・苦情を受け付けています。あっせん手続き実施者(あっせん委員)は、公正・中立な立場の弁護士が担当するので安心です。



## ADR FINMACの特長は?

**公正!**

金融商品取引法<sup>(※1)</sup>の指定・認定やADR促進法<sup>(※2)</sup>に基づく認証を受け、**中立的立場**で、苦情・紛争を解決します。

(※1)当センターは、特定第一種金融商品取引業務に係る指定紛争解決機関です。

また、第二種金融商品取引業者に係る認定投資者保護団体です。

(※2)ADR促進法、「裁判外紛争解決手続の利用の促進に関する法律」です。



**迅速!**

裁判では、かなり長い時間を要しますが、**あっせんは迅速**、概ね4ヶ月を目途に解決に努めます。

あっせんは損害賠償請求額に応じ、2千円から5万円をご負担していただきます。

**身近!**

あっせんは、お住まいのある**都道府県庁所在地**で行います。



## どのように相談にのってくれるの?



ステップ 1



相談・苦情  
無料

まずは、お電話ください。  
中立・専門の相談員が応じます。

ステップ 2



あっせん申立金  
2千円から5万円

あっせんの場合には、公正・  
中立の立場の弁護士があっ  
せん手続きを行います。

ステップ 3



**解決**

通常1~3回程度の話し合いに  
より、あっせんの成立(和解)、  
打ち切りなど対応がなされます。



ADR FINMAC

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

東京事務所 〒103-0025 東京都中央区日本橋茅場町2-1-13 第三証券会館

大阪事務所 〒541-0041 大阪府大阪市中央区北浜1-5-5 大阪平和ビル

●ご相談はお気軽に、お電話でどうぞ!

フリーダイヤル

**0120-64-5005**

(月~金曜日9:00~17:00 祝日等を除く)

<http://www.finmac.or.jp>