

指数先物・オプション取引の契約締結前交付書面新旧対照表

(下線部が変更箇所)

新	旧
<p>1. 指数先物取引の仕組みについて  <u>(5) 制限値幅</u>            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。</p>	<p>1. 指数先物取引の仕組みについて  <u>(5) 制限値幅</u>            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(原則として、前取引日の清算数値。)から、<u>上下 16%程度の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)</u>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。</p>
<p>2. 指数オプション取引の仕組みについて  <u>(4) ストラテジー取引</u>  <u>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。</u></p>	<p>2. 指数オプション取引の仕組みについて  <u>新設</u></p>
<p><u>(5) 制限値幅</u>            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。</p>	<p><u>(4) 制限値幅</u>            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、<u>前日の最終の指数を基準に、上下 16%程度の制限値幅(1日に変動し得る値幅)</u>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。</p>

	<p><b>(5) 取引の一時中断</b></p> <p>指数先物取引の各限月取引において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。</p> <p>この場合、指数オプション取引については、指数先物取引の限月取引に対応する限月取引(例えば、先物取引の3月限月に対しては、オプション取引の1、2、3月限月)を中断することとなります。</p>
<b>(7) 取引規制</b>	<p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a . 制限値幅の縮小</li> <li>b . 証拠金の差入日時又は預託日時の繰上げ</li> <li>c . 証拠金額の引上げ</li> <li>d . 証拠金の有価証券による代用の制限</li> <li>e . 証拠金の代用有価証券の掛目の引下げ</li> <li>f . 取引代金の決済日前における預託の受入れ</li> <li>g . 指数オプション取引の制限又は禁止</li> <li>h . 建玉制限</li> </ul> <p><b>(6) 取引規制</b></p> <p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a . 制限値幅の縮小</li> <li>b . 証拠金の差入日時又は預託日時の繰上げ</li> <li>c . 証拠金額の引上げ</li> <li>d . 証拠金の有価証券による代用の制限</li> <li>e . 証拠金の代用有価証券の掛目の引下げ</li> <li>f . 取引代金の決済日前における預託の受入れ</li> <li>g . 指数オプション取引の制限又は禁止</li> <li>h . 建玉制限</li> </ul>

カバードワラントの契約締結前交付書面新旧対照表

(下線部が変更箇所)

新	旧
<p>本ワラントの仕組みについて</p> <p>ニアピン e ワラント(ニアピン型ワラント)は、対象原資産の特定価格(ピン価格)を定め、満期日において満期参照原資産価格とピン価格が一致した場合に受け取り金額が最大(以下「最大満期決済金額」という)となり、一致していない場合、ピン価格と満期日の対象原資産価格の乖離額に1ワラント当たり原資産数を乗じた金額を最大満期決済金額から減じた額(但し0円以上)を得るタイプのオプションを表章したカバード・ワラントのことです。オプションは満期日にのみ行使できるヨーロピアン・タイプで、満期日において、対象原資産の市場価格のピン価格からの乖離額(但し0円以上)が、最大満期決済金額を1ワラント当たり原資産である <u>0.4</u> で除した金額よりも小さい場合、自動的に行使され、発行者はニアピン型 e ワラント所持人に対して満期決済金額を支払います。「満期決済金額」は1ワラントにつき、ピン価格と満期参照原資産価格の乖離額に1ワラント当たり原資産数を乗じた金額を最大満期決済金額から減じた額(但し0円以上)となります。</p>	<p>本ワラントの仕組みについて</p> <p>ニアピン e ワラント(ニアピン型ワラント)は、対象原資産の特定価格(ピン価格)を定め、満期日において満期参照原資産価格とピン価格が一致した場合に受け取り金額が最大(以下「最大満期決済金額」という)となり、一致していない場合、ピン価格と満期日の対象原資産価格の乖離額に1ワラント当たり原資産数を乗じた金額を最大満期決済金額から減じた額(但し0円以上)を得るタイプのオプションを表章したカバード・ワラントのことです。オプションは満期日にのみ行使できるヨーロピアン・タイプで、満期日において、対象原資産の市場価格のピン価格からの乖離額(但し0円以上)が、最大満期決済金額を1ワラント当たり原資産である <u>0.5</u> で除した金額よりも小さい場合、自動的に行使され、発行者はニアピン型 e ワラント所持人に対して満期決済金額を支払います。「満期決済金額」は1ワラントにつき、ピン価格と満期参照原資産価格の乖離額に1ワラント当たり原資産数を乗じた金額を最大満期決済金額から減じた額(但し0円以上)となります。</p>
<p>本ワラントに係る金融商品取引契約の概要</p> <p>当社における本ワラントのお取引については、以下によります。</p> <p style="padding-left: 2em;"><u>本ワラントの売買の取次</u></p>	<p>本ワラントに係る金融商品取引契約の概要</p> <p>当社における本ワラントのお取引については、以下によります。</p> <p style="padding-left: 2em;"><u>本ワラントの売買の媒介</u></p>

平成 21 年 9 月 30 日変更