# OSE 先物・オプション シミュレーター シミュレーション画面

株式会社シンプレクス・インスティテュート

作 成 日 最終更新日

 2014年9月1日

 2024年11月5日

# 目次

目次.		2
3	シミュレーション画面	3
3.1	画面の名称	3
3.2	各種ボタン	3
3.3	カレンダー	4
3.4	ニュース&アラート	5
3.5	マーケット	6
3.6	キャッシュマネジメント	7
3.7	銘柄一覧	9
3.8	発注	
3.9	注文管理	

# 3 シミュレーション画面

# 3.1 画面の名称

ilii 1	PX (	OSE先物	・オプシ	ヨン シミュー	ノーター	リスクパラ	メータ:デル	タとは			ID:		進む	ヘルプ	終了
現在 当シナリ: 終了日	オの	2020/10 2020/10	)/27 01:15 )/27 03:30	残り 現り 1日 この	<mark>ュース</mark> このシナ シナリオについて	リオについて						D 各 種 ボ	タン		22,998.91 0.10%
最終注意	2	カレン	ダー	18日		3	ニュージ	ス&アう	ラート					uri Za	104.80
1 1 1 1 1 1	現金	振	基 先物・ 0	-ロ オプションロ暦 1,00	残高 0,000	証拠金	0	5++	ッシュマ	ネジメン	<mark>۲</mark>	損益合計	(4)	ーケッ	
			保有銘柄	ポジション	リスクパラメ	-9 UZ2	バリュー								
銘杯	9	種別	限月	行使価格	現在値	前日比 %	IV	数量	3	平均単価	評価損益	実	現損益	損益	合計
M225	-11	82	11月		23,000	0	-		0	-		0	0		0 ^
C11-2	235	コール	11月	23,500	200	-5	20.0%		0	-		0	0		0
C11-2	240	コール	11月	24,000	88	-2	20.0%		0	-		0	0		0
C11-2	245	コール	11月	24,500	33	-1	20.0%		0	-		0	0		0
P11-2	20	プット	11月	22,000	78	-1	20.0%			<b>⑥銘柄</b> -	- 暫	0	0		0
P11-2	25	フット	11月	22,500	190	-5	20.0%				90	0	0		0
P11-2	230	フット	11月	23,000	395	-5	20.0%		0			0	0		0
607 + TE 6	27+T + 1		×-+++ >			7/270		感计算册	I IIII	AT	(持た)	约宁这			今取消
\$61P3 \$	昭内で	選択してくだ		0 1	選択し	JUCKEEN	•	光江自生	シャート	5 点/管	1070                            	新 <b>尼府</b> 登注価格	状能	<u>لات</u>	定值
	-			⑦発泪	E .			7./187	serio -	- 1	R 76/19X	元/工1四/1日	1/162	10.27	
売気配	-	- <del>○</del> 新	í規 🚺			○新規	○転売/買戻								
現値	-		い 0月	もり 現	值 -	◯買い	○売り		N N/N			04.	2		
買気配	-	- <mark>○成</mark>	行 〇指	10 買気	- 587	〇成行	〇指値	8	旧又省	理		リチャ			
前日比	-	値段 🗐			3LL - 10	直段 →					4 L				
TV	-	数量 ↓			/ - *										
				発注	. 2		発注								-

No.	エリア名称	概要
1	各種ボタン	開始・終了・一時停止・ヘルプ等を表示します。
2	カレンダー	現在時刻、終了日や最終決済日を表示します。
3	ニュース&アラート	ニュースのヘッドラインを表示します。
		警告メッセージがあるときは、ここに表示されます。
4	マーケット	指数や金利等の情報を表示します。
5	キャッシュマネジメント	現金や口座残高、証拠金、損益、手数料を表示します。
6	銘柄一覧	売買可能銘柄の一覧です。現値や持ち高、損益、リスクパラメータやリスクバ
		リューを表示します。
7	<u>発注</u>	ここから発注します。
8	注文管理	発注済の注文とその状況を表示します。
9	チャート	日経平均株価指数の日足ローソク足チャートを表示します。

# 3.2 各種ボタン

# 「スタート」ボタン

シミュレーションを開始するためのボタンです。 (シミュレーションを開始した後は、「一時停止」/「進む」ボタンに切り替わります。)

# 「一時停止」ボタン

シミュレーションを一時停止するためのボタンです。クリックすると、時計が止まります。

#### 「進む」ボタン

一時停止中にクリックすると、シミュレーションが再開し、時計が動きだします。

#### 「ヘルプ」ボタン

マニュアル(PDFファイル)を表示するボタンです。操作やルール、画面上の文言等についてわからないことがあるときは、ヘルプボタンをクリックしてください。別画面でマニュアルが開きます。

#### 「終了」ボタン

シミュレーションを中断するためのボタンです。終了ボタンをクリックした後、確認ボタンが表示されます。「OK」をクリックす ると、シミュレーションが中断されます。

(注)途中から再開はできませんのでご注意ください。

「キャンセル」をクリックすると、シミュレーションが再開します。

# 3.3 カレンダー

現在	2020/10/27 01:15	残り
当シナリオの 終了日	2020/10/27 03:30	1日
最終決済日1	2020/11/13 09:00	18日
最終決済日2	-	-日
最終決済日3	-	-日

#### 現在

ミュレーション内の仮想の日時を表示します。日付が変わるときに、鳩時計のような音 **月** が鳴ります。 (注)休日はありませんので、シミュレーション中はいつでも売買可能です。 (注)時間の進むスピードは、シミュレーション毎に異なります。 また、シミュレーション途中でスピードが変化することもあります。シミュレーションを一時停止するためのボタンです。クリッ クすると、時計が止まります。

#### 終了日

シミュレーションが終了する日時です。「残り」は、終了までの日数です。終了日時を基準に、あと何日シミュレーションが継続するかを示します。

例: 20XX 年 9 月 11 日 10:00 が終了日の場合、9 月 10 日の 10:00 を過ぎると残り1 日と表示されます。

# 最終決済日

先物およびオプションの最終決済日(満期日)を示します。最終決済日1が期近、最終決済日2が期先です。ただし、扱う限月が1種類のシミュレーションの場合、最終決済日2以降は表示されません。

「残り」は、最終決済日までの残存日数です。最終決済日当日の9:00を基準に、あと何日取引が可能かを示します。 例: 20XX年9月11日 9:00 が最終決済日の場合、9月10日の9:00を過ぎると残り1日と表示されます。

最終決済日を過ぎると、「残り」には「-(ハイフン)」が表示されます。

# 3.4 ニュース&アラート

#### 3.4.1 ニュース画面

#### ニュース・ヘッドライン

ニュースのヘッドラインが配信されると、配信音 **月** が鳴ります。ニュースのヘッドラインのうち、最新ニュースは最上部に 表示されます。ニュースのヘッドラインは、クリックすると詳細を読むことができます。

一覧に戻る

最新ニュース 日経平均が50円上昇しました。

日経平均が50円上昇しました。

「C11-245」のデルタを確認しましょう

「デルタ」 について

このシナリオについて

#### ニュース詳細

ヘッドライン上をクリックすると、ニュースの詳細が表示されます。 (注)ニュース配信後に、自動的に一時停止する場合があります。

最上部は、現在配信されているニュースのうち最新ニュースのヘッドラインです。

その下の枠の中に、現在参照しているニュースのヘッドラインと詳細が表示されます。

ニュースの詳細を参照中に次のニュースが配信されると、最新ニュースのヘッドラインが最上部に表示されます。新しいニ ュースが配信されるときには、「最新ニュース」の文字が赤く点滅します。最上部に表示されるのは、現在配信されているニ ュースのうち最新ニュースのヘッドラインです。

最新ニュース「P11-220」のデルタを再び確認しましょう 日経平均が50円上昇しました。
日経平均が50円上昇しました。
詳細を閲覧中のニュースのヘッドライン
詳細を閲覧中のニュースのヘッドライン
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*
\*</p

また、ニュース詳細画面から「一覧に戻る」ボタンをクリックすると、ニュースのヘッドライン一覧に戻ります。

#### 辞書

ニュース詳細中の青い文字をクリックすると、辞書が表示されます。 用語によっては、説明中にもさらに用語へのリンクがある場合や、さらに詳しい説明用の PDF ファイルをご用意している場 合もあります。「詳しい説明はこちら(PDF ファイル)」と記載されている場合は、詳細の説明があります。 (注)PDF ファイルを閲覧するためには、Adobe Reader 等のソフトウェアがインストールされている必要があります

#### 満期日

先物取引においては、予め定めた売買をする期日のことです。<u>オプション</u>取引においては、予め定めた売買の権利を 行使する期日のことです。 日経225先物・オプションでは各限月の第二金曜日が満期日です。満期日の前取引日が取引最終日で、大引けまで取

引可能ですが、満期日にはもはや取引はできません。満期日まで残った<u>建玉</u>は、自動的に<u>SQ値</u>を用いて最終決済が行

# 3.4.2 アラート

## 先物・オプションロ座がマイナスになった時のアラート

値洗い時に損失額が引かれて先物・オプションロ座残高がマイナスになると、下記のようなアラートが表示されます。その 翌日の正午にはロ座残高が0円以上になっている必要があります。翌日の正午までにロ座残高を0円以上にしないと、 強制的に全てのポジションを反対売買します。

現在 当シナリオの 終了日	2020/02/20 15:15 2020/03/13 09:00	残り 22日 だと、持高	り、口座残高がなくなりまし を増やすか、現金残高がある が全て強制反対売買されます	,た。不足額は70,000円です。 5場合は口座へ振替手続きをし 「。なお、強制反対売買の手数	,明日の正午までに、持高が って下さい。明日正午の段階で 対は、通常の手数料の10倍	ある場合は反対売買をし で口座残高が不足したまま です。
最終決済日1	2020/03/13 09:00	22日				
最終決済日2	2020/04/10 09:00	50日				
最終決済日3	-	-日		確認		
現金	振替 先物・ス	オプションロ座残高	証拠金	評価損益	実現損益	損益合計
	3,799,000	-70,000	1,200,000	-70,000	0	-70,000

現在	2020/02/21 12:00	残り 正午の時点	で口座残高が不足しているの	)で、ポジションを全て反対表	<b>に買します。 手数料は通常の</b>	10倍です。
当シナリオの 終了日	2020/03/13 09:00	21日				
最終決済日1	2020/03/13 09:00	21日				
最終決済日2	2020/04/10 09:00	49日				
最終決済日3	-	-日		確認		
現金	振替先物・ス	オプションロ座残高	証拠金	評価損益	実現損益	損益合計
	3,799,000	-70,000	1,200,000	-100,000	0	-100,000

# ゲームオーバーのアラート

なければゲームオーバーとなります。

持高全てが強制反対売買され、さらに現金から口座にお金を振り替えても、口座残高が0円以上になる見込みがなければ、ゲームオーバーとなります。ゲームオーバーとなると、シミュレーションが終了します。 (注)現金の残高が十分残っていても、口座残高がマイナスのままで、あなたが意図的に現金から口座にお金を振り替え

# 3.5 マーケット

マーケット情報が随時配信されます。これらの値は、シミュレーション中に変化することがありますので、注目してください。

日経半均	23,450.52
金利	-0.04%
米ドル/円	112.05

#### 日経平均

日経平均株価指数を表示します。

#### 金利

3ヶ月物金利を表示します。

#### 米ドル/円

円ドルレートを表示します。 例:上記の場合、1ドル=112円05銭

#### COMEX\_Gold

COMEX での金先物価格を表示します。

# 金

大阪取引所での金先物価格(中心限月)を表示します。

# 白金

大阪取引所での白金先物価格(中心限月)を表示します。

# 3.6 キャッシュマネジメント

# 3.6.1 キャッシュマネジメントエリア

現金 振替	先物・オプションロ座残高	証拠金	評価損益	実現損益	損益合計	手数料計
0	1,000,000	0	0	0	0	0

#### 現金

あなたが自由に使えるお金です。財布あるいは銀行口座内のお金だとお考えください。 「現金」を直接使って先物・オプションの取引はできません。先物・オプションの取引には、「先物・オプション口座」のお金 を使いますので、必要に応じて「振替」を行ってください。

# 先物・オプションロ座残高

先物・オプションを売買するための口座の残高を示します。 売買代金・手数料・証拠金は、先物・オプション口座残高から引かれます。 新規売買や転売/買戻だけでなく、値洗い(15時45分)によっても先物・オプションロ座残高は増減します。 先物・オプションロ座残高がマイナスとなると、アラートが表示されます。

#### 証拠金

先物の買い、先物の売り、オプションの売りには、証拠金が必要です。 ポジションの組み合わせによっては、単体での取引と比較して、証拠金額が減ることがあります。 証拠金額は、弊社独自の方法により算出した2日間の想定最大損失から計算されます。 (注)現実の証拠金の計算とは異なります。

#### 評価損益

持ち高がある全ての銘柄について、現値から計算した損益の合計です。現値が変化すると評価損益も変化します。

# 実現損益

全ての銘柄について、既に反対売買して損益が確定した分の損益の合計です。反対売買とは、買い持ちの銘柄を転売 し、売り持ちの銘柄を買い戻すことです。

#### 損益合計

全ての銘柄について、評価損益と実現損益を足したものです。 損益合計 = 評価損益 + 実現損益

#### 手数料計

全ての銘柄について約定した取引にかかった手数料の合計を示します。 (注)当シミュレーターでは、手数料に消費税はかかりません。

- ・日経平均先物(ラージ)・金標準先物の手数料は、1枚当たり1,000円です。
- ・日経 225mini(ミニ)の手数料は、1 枚当たり100 円です。
- ・日経 225micro(マイクロ)の手数料は、1 枚当たり10 円です。
- ・金ミニ先物・金限日先物・白金限日先物トの手数料は、1枚当たり100円です。
- (注)日経 225 先物、日経 225mini、金標準先物、金ミニ先物の SQ 決済には、手数料がかかります。
- ・日経 225 オプションの手数料は、約定代金の 0.2%です。最低手数料は 200 円です。
- ・日経 225 ミニオプションの手数料は、約定代金の 0.2%です。最低手数料は 20 円です。

(注)日経 225 オプション/日経 225 ミニオプションが SQ で権利行使となった場合は、手数料がかかります。権利放棄となった場合は、手数料がかかりません。

・金先物オプションの手数料は、1枚当たり、約定代金の0.2%です。最低手数料は200円です。

(注)金先物オプションが SQ で権利行使となった場合は、手数料がかかります。権利放棄となった場合は、手数料がかかりません。

# 3.6.2 振替画面

キャッシュマネジメントエリアには、「現金」および「先物・オプションロ座残高」が表示されていますが、この「現金」および 「先物・オプションロ座残高」間での資金の移動を行うのが振替画面です。

現金	振替	先物・オプションロ座残高
	500,000	500,000

「現金」セルの右にある「振替」ボタンをクリックすると、振替画面が表示されます。振替画面には、現在の現金残高、(先物・オプション)口座残高が表示されています。

振替		
現金	500,000	円
口座残高	500,000	円
◎現金か	ら口座へ	
○口座か	ら現金へ	
振替	100,000	円
キャンセ	フル 振替実行	

「現金から口座」あるいは「口座から現金へ」のいずれかを選択してチェックを入れ、「振替」フィールドに振替金額を入力して「振替実行」ボタンをクリックしてください。

残高を超える金額を振り替えようとすると、「振替可能額を超えています」というエラーメッセージが出ます。

振替をやめる場合は「キャンセル」ボタンをクリックしてください。

振替画面が出ている間は、時計が止まります。「振替実行」あるいは「キャンセル」ボタンをクリックすると、振替画面が消えて、時計が進みます。

#### 3.6.3 値洗いと証拠金について

値洗い時に損失額が引かれて先物・オプションロ座残高がマイナスになると、下記のようなアラートが表示されます。

現在 当シナリオの 終了日	2020/02/20 15:15 2020/03/13 09:00	残り 22日 だと、持高	り、口座残高がなくなりまし を増やすか、現金残高がある が全て強制反対売買されます	った。不足額は70,000円です る場合は口座へ振替手続きをし す。なお、強制反対売買の手者	。明日の正午までに、持高た して下さい。明日正午の段階 数料は、通常の手数料の10倍	がある場合は反対売買をし で口座残高が不足したまま 行です。
最終決済日1	2020/03/13 09:00	22日				
最終決済日2	2020/04/10 09:00	50日				
最終決済日3	-	-8		確認		
現金	振替 先物・ス	オプションロ座残高	証拠金	評価損益	実現損益	損益合計
	3,799,000	-70.000	1,200,000	-70.000	0	-70,000

その翌日の正午には口座残高が0円以上になっている必要があります。翌日の正午までに口座残高を増やしてください。口座残高を増やす方法は下記のとおりです。

- ・持ち高がある場合は、全部または一部を反対売買してください。売却代金が入金されたり、預けてあった証拠金額が戻ってくることで、先物・オプションロ座残高が増えることがあります。
- ・現金が残っている場合は先物・オプションロ座へお金を振り替えてください。「現金」のセルにある「振替」ボタンをクリックすると、振替画面が表示されます。「現金からロ座へ」をクリックして先物・オプションロ座残高を増やしてください。

その翌日の正午に口座残高がマイナスのままだと、持ち高があれば全て強制的に反対売買され、通常の10倍の手数料 が引かれます。

- ・ミニの通常の手数料は1枚100円ですが、強制反対売買だと1,000円となります。
- ・先物(ラージ)の通常の手数料は1枚100円ですが、強制反対売買だと1,000円となります。
- ・オプションの通常の手数料は約定代金の0.2%ですが、強制反対売買だと2%となります。

現在	2020/02/21 12:00	残り 正午の時点	で口座残高が不足しているの	)で、ポジションを全て反対表	<b>売買します。 手数料は通常の</b>	10倍です。
当シナリオの 終了日	2020/03/13 09:00	21日				
最終決済日1	2020/03/13 09:00	21日				
最終決済日2	2020/04/10 09:00	49日				
最終決済日3	-	-日		確認		
現金	振替先物・ジ	オプションロ座残高	証拠金	評価損益	実現損益	損益合計
	3,799,000	-70,000	1,200,000	-100,000	0	-100,000

もし、持高全てが強制反対売買され、さらに現金から口座にお金を振り替えても、口座残高が0円以上になる見込みがなければ、ゲームオーバーとなります。

(注)現金の残高が十分残っていても、口座残高がマイナスのままで、あなたが意図的に現金から口座にお金を振り替えなければゲームオーバーとなります。ゲームオーバーとなると、シミュレーションが終了します。

# 3.7 銘柄一覧

# 3.7.1 銘柄一覧

			保有銘柄	ポジション	リスクパラン	(-タ リス	クバリュー						
	銘柄	種別	限月	行使価格	現在値	前日比 %	IV	数量	平均単価	評価損益	実現損益	損益合計	
- [	M225-09	21	9月		15,000	C	-	C	-	0	C	) (	0 ^
	C09-153	コール	9月	15,375	22	C	24.0%	C	-	0	C	1	0
	C09-152	コール	9月	15,250	45	-1	24.5%	C	-	0	C	1	0
	C09-151	コール	9月	15,125	82	-1	24.8%	C	-	0	C	(	0
	C09-150	コール	9月	15,000	140	C	25.0%	C	-	0	C	) (	0
	C09-148	コール	9月	14,875	210	C	25.2%	C	-	0	C	(	0
	C09-147	コール	9月	14,750	300	C	25.5%	C	-	0	C	) (	0
	P09-152	プット	9月	15,250	300	C	24.7%	C	-	0	C	(	0
	P09-151	プット	9月	15,125	210	C	24.8%	C	-	0	C	) (	0 -

#### 銘柄

銘柄コードを表示します。

# インデックスシナリオ例:

L225-09 は、9 月限の日経 225 先物(ラージ)です。 M225-09 は、9 月限の日経 225mini(ミニ)です。 Mic225-09 は、9 月限の日経 225 マイクロ(マイクロ)です。 C09-280 は、9 月限の日経 225 オプションの権利行使価格 28,000 円のコールのことです。 Pm09-1W-280 は、9 月 1 週限の日経 225 ミニオプションの権利行使価格 28,000 円のプットのことです。

コモディティシナリオ例:

LGld-08 は、8 月限の金標準(ラージ)です。MGld-08 は、8 月限の金ミニ先物です。 C09-630 は、9 月限のオプションの権利行使価格 6,300 円のコールのことです。 GldS は、金限日先物、PlaS は白金限日先物です。

#### 種別

ラージ/ミニ/マイクロ/スポット/コール/ミニコール/プット/ミニプット の別が示されます。

#### 限月

最終決済日のある月です。

#### 行使価格

オプション(コール/プット)の権利行使価格が表示されます。先物には関係ないので、「・」が表示されます。

#### 現在値

その銘柄が、市場で最後に売買された値段です。

#### 前日比「円」/「%」

前日の終値と比較した絶対額(円)と、比(%)を切り替えて表示可能です。

#### IV

インプライド・ボラティリティ(%)を表示します。先物には IV は関係ないので、「・」が表示されます。

#### 数量

持高を表します。買建ての場合は正(プラス)の値、売建ての場合は負(マイナス)の値となります。 例:1枚の買建ての場合は「1」、1枚の売建ての場合は「-1」と表示されます。

約定により数量が変化した時、その銘柄のセルが赤色に点	気滅します。
----------------------------	--------

銘柄	種別	限月	行使価格	現在値	前日比 %	IV	数量
LGld-10	ラージ	10月		4,475	+5	-	0
MGld-10	32	10月		4,475	+5	-	1

両建の場合は、数量のセルが水色になり、買建玉(プラスの値)と売建玉(マイナスの値)の枚数の合計枚数が表示されま

す。(注)両建とは、同一銘柄について、買建てと売建の両方があることをいいます。

例:2枚の買建て(2)、1枚の売建て(-1)の場合、「1」と表示されます。

|--|

行使価格	現在値	前日比 %	IV	数量	平均単価	評価損益	実現損益
	4,475	+5	-	0	-	. 0	0
	4,474	+4	-	0	-	-100	0
4,550	43	+3	13.0%	<mark>両建てです。</mark>	クリックすると両	i建ての詳細が表示	<mark>されます。</mark> o
4,500	56	+3	12.0%	0	-	. 0	0

両建になっている銘柄の行をクリックすると、両建の詳細が表示されます。

#### ポジション詳細

ハンンコン叶州	4										
銘柄	種別	限月	行使価格	現在値	前日比%	IV	数量	平均単価	評価損益	実現損益	損益合計
MGld-10	211 211	10月		4,474	+4	-	1	4,475.00	-100	0	-100
							-1	4,474.00	0	0	0
閉じる											

両建の詳細画面上でクリックすると、新規あるいは転売/買戻のための発注画面を表示することができます。 買建ての銘柄の行上で「転売/買戻」を選択すると、「転売/買戻」、「売り」、「成行」および数量に保有枚数が入力された発 注画面が、売建ての銘柄の行上で「転売/買戻」を選択すると、「買い」が入力された発注画面が表示されます。

小ンンヨノ評和	9											
銘柄	種別	限月	行使価格	現在値	前日比%	IV	数	₫	平均単価	評価損益	実現損益	損益合計
MGld-10	211 21	10月		4,474	+4	新規		1	4,475.00	-100	0	-100
						転売	/雷定	-1	4,474.00	0	0	0
閉じる						+476	/ 7./					

#### 平均単価

持高がある場合、取得したコストを示します。複数枚数を保有している場合は、その平均値です。 例えば、日経 225 先物の買建て 2 枚の取得価格が、それぞれ 28,000 円、28,020 円の時、平均単価は 28,010 円となり ます。

平均単価 =  $(28,000 \text{ P} + 28,020 \text{ P}) \div 2 = 28,010 \text{ P}$ 

#### 評価損益

まだ反対売買(買い持ちのものを転売する、または、売り持ちのものを買い戻すこと)していない銘柄の値動きから発生する損益です。現値が変わると、評価損益も変化します。

#### 実現損益

既に転売または買い戻しをして実現した損益です。

#### 損益合計

評価損益と実現損益を足した数値です。

取引最終日の15時45分になると、その限月の先物・オプション(金標準を除く)は売買できなくなります。また最終決済日の15時45分になるとその限月の金標準は売買できなくなりますが、「実現損益」と「損益合計」の値は残ります。

# 3.7.2 リスクパラメータタブ

	保有銘柄	ポジション	リスクパラン	レータ リスク	クバリュー						
種別	限月	行使価格	現在値	前日比 %	IV	数量	デルタ	ガンマ	セータ	ベガ	0-
22	4月		16,740	-1,415	-	0	0.10	-	0.04	-	- ^
コール	4月	16,500	2,210	-550	62.5%	0	0.74	0.000103	-18.16	16.28	863
コール	4月	17,500	1,470	-610	55.9%	0	0.63	0.000134	-19.03	19.05	761
コール	4月	18,500	875	-595	50.8%	0	0.48	0.000156	-18.18	20.05	600

下記のタブで、ポジションタブ及び、リスクバリュータブと切り替えます。

	保有銘柄	ポジション	<b>ン</b> リスクパラン	メータ リス	クバリュー
種別	限月	行使価格	現在値	前日比 %	IV
11 11	4月		16,740	-1,415	5 -
コール	4月	16,500	2,210	-550	62.5%

リスクパラメータでは、売買可能なオプション1枚あたりのリスクパラメータを表示します。 持高を示す「数量」に関わらず、オプション1枚あたりのリスクパラメータが表示されています。

#### デルタ

デルタとは、原証券(この場合は日経平均の値)が1円変化した時に、オプションの値段がいくら変化するかを示す数値です。

#### ガンマ

ガンマとは、原証券である日経平均の値が1円動いた時に、デルタがいくら変化するかを示す数値です。

# セータ(タイム・ディケイ)

セータとは、日付が1日進んだ時に、オプションの値段がいくら下がるかを示す数値です。

#### ベガ

ベガとは、IV(インプライド・ボラティリティ)が1%変化した時に、オプションの値段がいくら変化するかを示す数値です。

#### **—**

ローとは、金利が1%変化した時に、オプションの値段がいくら変化するかを示す数値です。

# 3.7.3 リスクバリュータタブ

下記のタブで、ポジションタブ及び、リスクバリュータブと切り替えます。

/ リスクパラン	メータ リス・	クバリュー	合計	0.15	-0.000021	-0.84	-1.00	237.39
現在値	前日比 %	IV	数量	デルタ	ガンマ	セータ	ベガ	<b>—</b>
16,740	-1,415	-	0	0.00	-	0.00	-	-
2,210	-550	62.5%	0	0.00	0.000000	0.00	0.00	0
1,470	-610	55.9%	0	0.00	0.000000	0.00	0.00	0
875	-595	50.8%	0	0.00	0.000000	0.00	0.00	0
535	-390	62.5%	0	0.00	0.000000	0.00	0.00	0
790	-460	55.9%	1	-0.37	0.000134	-19.06	19.05	-580
1,190	-440	50.8%	-1	0.52	-0.000156	18.22	-20.05	817
	<ul> <li>リスクバラン 現在値</li> <li>16,740</li> <li>2,210</li> <li>1,470</li> <li>875</li> <li>535</li> <li>790</li> <li>1,190</li> </ul>	リスクパラメータ         リス・           現在値         前日比 16,740           16,740         -1,415           2,210         -550           1,470         -610           875         -595           535         -390           790         -460           1,190         -440	リスクバラメータ         リスクバリュー           現在値         前日比 %         IV           16,740         -1,415         -           2,210         -550         62.5%           1,470         -610         55.9%           875         -595         50.8%           535         -390         62.5%           790         -460         55.9%           1,190         -440         50.8%	リスクパラメータ         リスクパリュー         合計           現在値         前日比 앱         IV         数量           16,740         -1,415         -         0           2,210         -550         62.5%         0           1,470         -610         55.9%         0           875         -595         50.8%         0           535         -390         62.5%         1           1,190         -440         50.8%         -1	リスクパラメータ         リスクパリュー         合計         0.15           現在値         前日比 1V         数量         デルク           16,740         -1,415         -         0         0.00           2,210         -550         62.5%         0         0.00           1,470         -610         55.9%         0         0.00           875         -595         50.8%         0         0.00           535         -390         62.5%         0         0.00           790         -460         55.9%         1         -0.37           1,190         -440         50.8%         -1         0.52	リスクパラメータ         リスクパリュー         合計         0.15         -0.00021           現在値         前日比 1         数量         デルタ         ガンマ           16,740         -1,415         -         0         0.00         -           2,210         -550         62.5%         0         0.00         0.000000           1,470         -610         55.9%         0         0.00         0.000000           875         -595         50.8%         0         0.00         0.000000           535         -390         62.5%         0         0.00         0.000000           790         -460         55.9%         1         -0.37         0.00134           1,190         -440         50.8%         -1         0.52         -0.000156	リスクバラメータ         リスクバリュー         合計         0.15         -0.000021         -0.84           現在値         前日比 圖         IV         数量         デルタ         ガンマ         セータ           16,740         -1,415         -         0         0.00         -         0.00           2,210         -550         62.5%         0         0.00         0.00000         0.00           1,470         -610         55.9%         0         0.00         0.00000         0.00           875         -595         50.8%         0         0.00         0.00000         0.00           535         -390         62.5%         0         0.00         0.00000         0.00           790         -460         55.9%         1         -0.37         0.00134         -19.06           1,190         -440         50.8%         -1         0.52         -0.00156         18.22	リスクバラメータ         リスクバリュー         合計         0.15         -0.000021         -0.84         -1.00           現在値         前日比 圖         IV         数量         デルタ         ガンマ         セータ         ベガ           16,740         -1,415         -         0         0.00         -         0.00         -         0.00         -         -         0.00         -         -         0.00         -         -         0.00         -         -         0.00         -         -         0.00         -         -         0.00         -         -         0.00         -         0.00         -         0.00         -         0.00         -         0.00         -         0.00 <td< td=""></td<>

「リスクパラメータ」タブに記載されている、オプション1枚あたりのリスクパラメータに、数量をかけた値が表示されます。そ

のため、持ち高のある銘柄のみ、その銘柄についてのリスクパラメータ合計が表示されます。 例:上記銘柄の数量が「-1」となっているので、「1枚の売建て」についてのリスクパラメータを示しています。

# 合計

最上部の「合計」は、先物、mini、オプションを含む全てのポジション(持ち高)を合計したリスクバリューを表示します。

# 3.7.4 保有銘柄

「保有銘柄」ボタンをクリックすると、持ち高のある銘柄のみを一覧で表示します。

保有銘柄一覧

銘柄	種別	限月	行使価格	現在値	前日比 %	IV	数量	平均単価	評価損益	実現損益	損益合計
M225-09	21 21	9月		23,110	-15		-1	23,170.00	6,000	0	6,000
M225-10	2.1 1	10月		23,115	-15		-3	23,115.00	0	0	0
C09-230	コール	9月	23,000	230	-65	20.0%	2	200.00	60,000	0	60,000
閉じる											

保有銘柄のライン上でクリックし、「新規」ボタンをクリックすると、新規のための発注画面が表示されます。 保有銘柄のライン上でクリックし、「転売/買戻」ボタンをクリックすると、転売/買戻のための画面が表示されます。この場合、 「発注」画面には、最初から「転売/買戻」にチェックが入り、数量は保有枚数が表示されます。

# 3.8 発注

# 3.8.1 発注画面

左右のい	ずれからも	発注ができます。						
銘柄	銘柄を選払	尺してください		~	銘柄	銘柄を選	択してください	~
	-					-		
売気配	-	○新規	○転売/買	戻	売気配	-	○新規	○転売/買戻
現値	-	○買い	○売り		現値	-	◯買い	○売り
買気配	-	〇成行	○指値		買気配	-	〇成行	○指値
前日比	-	値段 +		-	前日比	-	値段 +	-
IV	-	数量 +		-	IV	-	数量 🕂	Ξ
			発注					発注

#### 銘柄

銘柄を選んでください。ドロップダウンから選択できます。

銘柄	銘柄を選択してください 🗸	銘柄	銘柄を選
	銘柄を選択してください		-
売気配	M225-11	売気配	-
刊值	C11-235	邗值	-
-75112	C11-240	-576112	
買気配	C11-245	買気配	-
前日比	P11-220	前日比	-
IV	P11-225	IV	-
	P11-230		

# 新規/転売/買戻

どちらか選択してください。持ち高がある銘柄のみ、保有数量まで転売/買戻注文が出せます。保有していないポジション を転売/買戻しようとすると、「ポジション不足です。」エラーメッセージが表示されます。

銘柄	M225-11 🗸						
11月	11月日経mini						
売気配	23,005	○新規	●転売/買戻				
現値	23,000	○買い	●売り				
買気配	23,000	◎成行	○指値				
前日比	0 1ĩ	直段 +	0 —				
IV	- <u>*</u>	数量 🕂	1 -				
ポジショ	ョン不足です。		発注				

# 買い/売り

「買い」か「売り」のいずれかを選択してください。選択しないで発注すると、「買い/売りをチェック。」というエラーメッセージが表示されます。

銘柄	M225-11		~				
11月	11月日経mini						
売気配	23,005	●新規	○転売/買戻				
現値	23,000	○買い	○売り				
買気配	23,000	◎成行	○指値				
前日比	0 値	直段 🕂	0 —				
IV	- 娄	牧量 🕂	1 –				
買い/売	りをチェック	•	発注				

# 成行/指値

注文形態のうち、「成行(なりゆき)」と「指値」からいずれかを選択してください。

「成行」を選択すると、値段は「0(ゼロ)」となります。「成行」で発注すると、「買い」の場合は「売気配値」、「売り」の場合は

「買気配値」で約定します。「成行」を選択したのに「値段」に「0(ゼロ)」以外の値を入力すると、「成行注文です。」というエラーメッセージが表示されます。

「指値」の場合は、値段を指定してください。買い指値では、売気配値以上の値を指定すると売気配値で約定し、売気配値未満だと「待ち」となります。売り指値では、買気配値以下の値を指定すると買気配値で約定し、買気配値を超えると「待ち」となります。

銘柄	C11-235		~
11月	C23500		
売気配	205	●新規	○転売/買戻
現値	200	○買い	●売り
買気配	200	◎成行	○指値
前日比	-5	値段 +	100 –
IV	20.0%	数量 +	2 –
成行注文	েটেক,		発注

# 値段

「成行」注文の場合は、必ず「0(ゼロ)」となります。「指値」注文の場合は値段を指定してください。直接値を入力しても構いませんし、+ボタン、マイナスボタンで値段を調整できます。商品によって呼値が違いますので、値を入力する際はご注意ください。値段に正の整数以外の値(負の値や記号など)を入力して発注すると、「価格が不正です。」というエラーメッセージが表示されます。

銘柄	C11-235		~
11月	C23500		
売気配	205	●新規	○転売/買戻
現値	200	◯買い	◎売り
買気配	200	〇成行	●指値
前日比	-5	値段 🕂	a —
IV	20.0%	数量 🕂	2 –
値段がイ	下正です。		発注

# 数量

枚数を入力してください。+ボタン、マイナスボタンで値段を調整できます。数量は、必ず正の整数としてください。 (注)売りポジションの保有枚数はマイナスの値で表示されますが、発注時は「売り」を指定して正の整数を指定します。 数量に正の整数以外の値(負の値や記号など)を入力して発注すると、「数量が不正です。」というエラーメッセージが表示 されます。

銘柄	M225-11 ~						
11月	11月日経mini						
売気配	23,005	●新規	○転売/買戻				
現値	23,000	◯買い	○売り				
買気配	23,000	◎成行	○指値				
前日比	0 1	値段 +	0 —				
IV	- 3	数量 +	5ab —				
数量がる	下正です。		発注				

#### 「発注」ボタン

発注内容を確認したら、発注ボタンをクリックして発注してください。 (注)確認画面は表示されませんので、ご注意ください。

先物・オプションロ座残高が十分でない場合、「残高不足です。」のエラーメッセージが表示されます。



必要証拠金額 = 1,400,000 円 × 2 枚 = 2,800,000 円 手数料= 1,000 円 × 2 枚 = 2,000 円 必要な資金 = 2,800,000 円 + 2,000 円 = 2,802,000 円⇒ 残高不足のエラーとなる。

銘柄	M225-11				~
11月日経mini					
売気配	23,00	5	●新規	○転売,	/買戻
現値	23,00	0	●買い	○売り	
買気配	23,00	0	◎成行	○指値	
前日比	0	値段	+		0 —
IV	20.0%	数量	+	100	00 –
残高不足	೬೮ಕ.			3	ě注

# 3.8.2 注文の訂正

注文管理画面で、「状態」が「待ち」となっている注文は、「訂正」が可能です。「待ち」となっている注文の行でクリックし「訂 正」ボタンをクリックすると、訂正画面が表示されます。

発注管理	チャート	€T	待ち	約定済		全取消
発注番号	銘柄名	売/買	発注数	発注価格	状態	約定値
1	09月日経mini	新規買	1	14,970	待ち <u></u>	-
					取》	肖
					<b>≣</b> JI	E

訂正可能な事項は、下記のとおりです。

- ・指値の値段
- ・「指値」から「成行」への変更
- ・数量(減らす場合のみ)(注)

変更後に「発注」ボタンをクリックしてください。 訂正をやめる場合は、「中止」ボタンをクリックしてください。

訂正			
銘柄	M225-03		
3月日	]経mini		
売気配	23,550	●新規	●転売/買戻
現値	23,550	◯買い	○売り
買気配	23,545	〇成行	●指値
前日比	360 値	段 +	23,530 -
IV	- 数	(量  +	1 -
		中止	発注

(注)数量の変更は、減らすことはできますが、増やすことはできません(時間優先の原則)。数量を増やしたい場合は、新 規に発注してください。数量を訂正で増やそうとすると、「数量は増やせません。」というエラーメッセージが表示されます。 例:1枚の新規買い注文を、2枚に増やして訂正しようとした場合(下図)

訂正			
銘柄	M225-03		
3月	日経mini		
売気配	23,550	○新規	○転売/買戻
現値	23,550	◯買い	○売り
買気配	23,545	〇成行	●指値
前日比	360	値段 +	23,530 –
IV	- 4	数量 +	2 –
数量は	曽やせません。	,中止	発注

訂正画面を出している途中で約定してしまった注文を訂正しようとして発注した場合、「約定済です。」というエラーメッセージが表示されます。この場合、既に注文が約定しているため、訂正はできません。

訂正				
銘柄 M	225-03	;		
3月日約	≊mini			
売気配	23,4	95	●新規	○転売/買戻
現値	23,4	95	◯買い	○売り
買気配	23,4	90	〇成行	●指値
前日比	15	値段	ž +	23,525 –
IV	-	数量	+	1 –
約定済です	す。		中止	発注

訂正画面を出している途中で最終決済日を迎え消滅してしまった注文を訂正しようとして発注した場合、「失効しています。」というエラーメッセージが表示されます。この場合、既に注文が失効しているため、訂正はできません。

訂正			
銘柄	M225-03		
3月	日経mini		
売気配	23,495	●新規	○転売/買戻
現値	23,495	●買い	○売り
買気配	23,490	〇成行	●指値
前日比	15 <b>(</b> i	直段 +	23,525 –
IV	- 3	数量 🕂	1 -
失効して	ています。	中止	発注

# 3.8.3 注文の取り消し

#### 一件の注文を取り消す場合

注文管理画面で、「状態」が「待ち」となっている注文は、「取消」が可能です。「待ち」となっている注文の行でクリックし「取消」ボタンをクリックすると、その一件の注文が取り消されます。取消が完了すると、状態が「取消」となります。 (注)確認画面は表示されません。

発注管理	チャート	全	<del>ک</del>	待ち		約定済			全取消	Ű,
発注番号	銘柄名		売/買	! 発注	数	発注価格		状態	約定値	
1	09月日経min	i	新規買	Ę	1		14,970	待ち		-
								取》	消	
								<u>≣Tī</u>	E	

#### すべての注文を取り消す場合

「全取消」ボタンをクリックすると、状態が「待ち」(未約定)の注文について、全てを取り消します。取消が完了すると、状態が「取消」となります。

(注)確認画面は表示されません。

# 3.9 注文管理

発注管理	チャート		全て	待	ち		約定済				全取消
発注番号	銘柄名		売/買	1	発注数		発注価格		状態		約定値
5	20/10金	mini	買戻			5		6,710	完了		6,710
4	10月P6	700	転売		3		成行		完了		97
3	20/10金	標準	新規調	Ę	1		6,700		待ち		-
2	20/10金	標準	新規調	Ę		1		6,708	取消		-
1	20/10金	標準	新規調	Ę		1	成	行	完了		6,710

発注済みの注文が、時系列で表示されます。最新の注文は最上部に表示されます。

#### 各種タブ

「全取消」ボタンをクリックすると、状態が「待ち」(未約定)の注文について、全てを取り消します。取消が完了すると、状態が「取消」となります。

(注)確認画面は表示されません。

「全て」・・・・これまで発注した全ての注文(エラー含む)が表示されます。

「待ち」・・・・・状態が「待ち」(未約定)の注文のみ表示します。

「約定済」・・・・状態が「完了」(約定)の注文のみ表示します。

「全取消」・・・・・状態が「待ち」(未約定)の注文全てを取り消します。確認画面は表示されません。

#### 発注番号

発注順に、連番で番号が割り振られます。訂正をしても、発注番号は変化しません。

#### 売/買

売買の種類が表示されます。 新規買・・・・新規買いです。 新規売・・・・新規売りです。 買戻・・・・返済買いです。 転売・・・・返済売りです。 清算買・・・・・SQ決済の買いです。※先物の自動反対売買、オプションの自動権利行使、自動権利放棄を含みます。 清算売・・・・・SQ決済の売りです。※先物の自動反対売買、オプションの自動権利行使、自動権利放棄を含みます。 強制買・・・・・強制反対売買の買いです。 強制売・・・・・強制反対売買の売りです。

#### 発注数

発注枚数です。当シミュレーションでは部分約定(一部出来)がないため、約定した注文については、発注数=約定数となります。

#### 発注価格

指値注文の場合は指定した指値が表示されます。成行注文の場合は「成行」と表示されます。 SQ決済における「清買」、「清売」の時は、先物・オプションともに全て「0」と表示されます。

#### 状態

待ち・・・・・未約定の指値注文です。 完了・・・・・約定した注文です。 取消・・・・・約定前に取り消された注文です。 失効・・・・・・状態が「待ち」のまま SQ にて失効した注文です。

発注時と「状態」に変更があった時は、その注文の「状態」セルが赤色に点滅します。

状態が「待ち」となっている注文は、「訂正」と「取消」が可能です。 「待ち」となっている注文の行でクリックし「訂正」をクリックすると、訂正画面が表示されます。指値の値段変更や、指値から 成行への変更が可能です。変更後に「発注」ボタンをクリックしてください。

「待ち」となっている注文の行でクリックし「取消」をクリックすると、その1件の注文が取り消されます。

「全取消」ボタンをクリックすると、状態が「待ち」(未約定)の注文について、全てを取り消します。(注)確認画面は表示されません。 取消が完了すると、状態が「取消」となります。 (注)確認画面は表示されません。

#### 約定値

約定した値段が表示されます。 「待ち」「取消」「失効」の状態の場合は「・」が表示されます。 先物の SQ 決済では、SQ 値が表示されます。 オプションの SQ で権利放棄となった場合は、「0.00」と表示されます。 オプションの SQ でイン・ザ・マネーとなった場合は、SQ 値と権利行使価格との差額が表示されます。

#### チャート

実施中のシナリオの、日経平均株価指数の日足ローソク足チャートを表示します。 チャートは、シナリオでの2取引日目から表示されます。

縦軸・・・・インデックスシナリオの場合、日経平均株価指数の目盛が表示されます。コモディティシナリオの場合、金標準 (複数限月存在する場合は期先)の目盛が表示されます。

横軸・・・・・仮想時間の月日の一部が表示されます。



(注)以上全て、このシミュレーション内の独自のルールです。現実の市場にはあてはまらないこともありますので、ご了承く ださい。