

店頭FX取引に係るリスク情報

計測日時: 2020年3月31日

イ. 未カバー率は、23:00、25:00、27:00の3時点のうち未カバーポジションの額が最大となる時点で計測

ロ. カバー取引の状況は、23:00、25:00、27:00の3時点のうちカバー取引先における建玉の合計額が最大となる時点で計測

ハ. 平均証拠金率は、取引終了時点で計測

イ. 未カバー率 > カバーされていないポジションは、為替相場の変動の影響を直接受けることになります。

【計算式】 (未カバーポジション^(注) / |顧客の買い建玉 - 顧客の売り建玉|) × 100

(注)顧客の建玉のうち、顧客の建玉同士で売り買いが対当しておらず、かつ、カバーされていない顧客の建玉

| |
|--------|
| 未カバー率 |
| 4.42 % |

ロ. カバー取引の状況 > カバー取引先が破綻した場合には、再構築コスト等が発生することになります。

【各区分の計算式】

(各区分のカバー取引先における買建玉と売建玉の合計 / 全カバー取引先における買建玉と売建玉の合計) × 100

| 【 A 】 | 【 B 】 | 【 C 】 | 【 D 】 |
|---------|---------|---------|---------|
| 29.23 % | 28.65 % | 21.05 % | 15.40 % |
| 【 E 】 | 【 】 | 【 】 | 【 】 |
| 5.67 % | % | % | % |

※カバー取引のシェアが高いものから順に記載しており、英字表記は特定のカバー取引先を指すものではありません。
 ※カバー取引先は全て、投資適格水準(BBB-以上、格付付与はS&Pグローバル・レーティングによる)となっております。

ハ. 平均証拠金率 > 証拠金率が低い場合には、顧客未収金リスクが大きくなります。

【計算式】 実預託額 / (顧客の買い建玉 + 顧客の売り建玉) × 100

| |
|--------|
| 平均証拠金率 |
| 16.27% |

(参考)

店頭FX取引を行う金融商品取引業者は、金融商品取引業等に関する内閣府令第117条第1項第28号の2の規定に基づき、特定通貨関連店頭デリバティブ取引(店頭FX取引)に係る上記リスク情報を開示することが義務付けられております。

以上