

店頭FX取引に係るリスク情報

計測日時：2020年03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。

$$\left[\text{【計算式】 } \frac{\text{未カバーポジション}^{(\text{注})}}{|\text{顧客の買い建玉} - \text{顧客の売り建玉}|} \times 100 \right]$$

(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
65.2%

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。

$$\left[\text{【各区分の計算式】 } \frac{\text{各区分のカバー取引先における買建玉と売建玉の合計}}{\text{全カバー取引先における買建玉と売建玉の合計}} \times 100 \right]$$

【BBB以上】
100.0%

※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。

$$\left[\text{【計算式】 } \frac{\text{実預託額}}{\text{顧客の買い建玉} + \text{顧客の売り建玉}} \times 100 \right]$$

平均証拠金率
30.0%

(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