

店頭FX取引に係るリスク情報

計測日時：2023年08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 |
|-------|
| 53.1% |

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

| 【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。

【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 |
|--------|
| 13.2% |

(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