

店頭 FX 取引に係るリスク情報に関する開示

計測日：2024 年 4 月 30 日

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）に係る下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。

- 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となります。

$$\left[\begin{array}{l} \text{【計算式】 (未カバーポジション (注) / |顧客の買い建玉 - 顧客の売り建玉|) } \times 100 \\ \text{(注) 顧客の建玉のうち、顧客の建玉同士で売り買いが対当しておらず、かつ、カバーされていない顧客の建玉} \end{array} \right]$$

未カバー率
46.99%

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となります。

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

【BBB以上】	【格付なし】
54.0%	46.0%

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。

$$\left[\begin{array}{l} \text{【計算式】} \\ \text{実預託額 / (顧客の買い建玉 + 顧客の売り建玉) } \times 100 \end{array} \right]$$

平均証拠金率
24.8%

当社は、店頭外国為替証拠金取引による一般のお客様からの取引に加え、個別契約による他の金融商品取引業者と取引を行っております。平均証拠金率には、店頭外国為替証拠金取引である一般のお客様からの取引と、B to B 取引である他の金融商品取引業者からの取引を合算し算出しております。