

店頭 FX 取引に係るリスク情報に関する開示

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)に係るリスク情報を開示することが義務付けられております。

計測日	イ. 未カバー率	ロ. カバー取引の状況		ハ. 平均証拠金率
		【投資適格(BBB-以上)】	【格付なし】	
2023年8月31日	11.79%	53.44%	46.56%	20.31%
2023年9月29日	7.92%	62.97%	37.03%	21.48%
2023年10月31日	8.26%	62.91%	37.09%	21.19%
2023年11月30日	7.60%	59.28%	40.72%	20.12%
2023年12月29日	10.38%	61.25%	38.75%	22.82%
2024年1月31日	14.49%	58.18%	41.82%	21.49%
2024年2月29日	11.92%	56.02%	43.98%	20.20%
2024年3月29日	7.26%	60.11%	39.89%	21.30%
2024年4月30日	10.89%	61.56%	38.44%	20.90%
2024年5月31日	9.87%	67.02%	32.98%	20.89%
2024年6月28日	11.27%	66.81%	33.19%	21.93%
2024年7月31日	3.24%	64.45%	35.55%	21.79%
2024年8月30日	12.61%	60.52%	39.48%	24.04%

■計測日時について

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

■リスクの算出方法について

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

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

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

以上