

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います。

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】	
2019年9月30日	7.08%	32.03%	67.97%	23.74%
2019年10月31日	7.33%	28.13%	71.87%	22.26%
2019年11月29日	8.40%	19.17%	80.83%	21.16%
2019年12月31日	0.00%	19.66%	80.34%	21.90%
2020年1月31日	0.01%	29.48%	70.52%	20.05%
2020年2月28日	0.33%	32.55%	67.45%	23.76%
2020年3月31日	4.32%	41.41%	58.59%	27.48%
2020年4月30日	9.49%	40.50%	59.50%	26.18%
2020年5月29日				
2020年6月30日				
2020年7月31日				
2020年8月31日				

■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