

店頭FX取引に係るリスク情報に関する開示

計測日時：2021年12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
0%

- ロ. カバー取引の状況 ▶ カバー取引先を外部格付機関の格付に基づき区分をした上で、全カバー取引に占める各区分のカバー取引の割合を示しています。
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

【格付あり】	【格付なし】
0%	100%

※当社のカバー取引先は、SBI リクイディティ・マーケット株式会社およびCITIBANK,N.A.です。

カバー取引は、お客さまの注文約定と同時に、全ての注文をシステムによる自動発注で、SBIリクイディティ・マーケット株式会社に発注します。同社との間で成立した当日分のカバー取引は、一部の通貨ペアを除いて、プライムブローカレッジ契約に基づき、当社とCITIBANK,N.A.の取引として付け替えます。

本項目は、直接のカバー取引先であるSBI リクイディティ・マーケット株式会社との取引状況を開示しています。

なお、SBIリクイディティ・マーケット株式会社は株式会社SBI証券の100%子会社であり、株式会社SBI証券は株式会社格付投資情報センター（R&I）より“(A-)”の格付が付与されています。

- 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
25.8%

(参考)

店頭 F X 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 F X 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います。

以上