

## 店頭F X取引に係るリスク情報に関する開示

計測日時：2021年8月31日

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。

【計算式】 (未カバーポジション<sup>(注1)</sup> / |お客様の買い建玉-お客様の売り建玉|) × 100

(注1) お客様の建玉のうち、お客様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お客様の建玉です。

|       |    |
|-------|----|
| 未カバー率 | 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となります。

【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】   | 72% |
| 【BBB未満】   | 0%  |
| 【格付なし】 ※1 | 28% |

格付付与：S&Pグローバル・レーティング・ジャパン株式会社

※1 格付なしのカバー先は、そのグループ会社に対して株式会社格付投資情報センターよりBBB以上の格付を付与されているため、投資適格カバー先に該当しております。

ハ. 平均証拠金率 ➤ 証拠金率が低い場合には、お客様の未収金リスクが大きくなります。

【計算式】 実預託額 / (お客様の買い建玉+お客様の売り建玉) × 100

|        |     |
|--------|-----|
| 平均証拠金率 | 22% |
|--------|-----|

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おります。

以 上