

## 店頭F×取引に係るリスク情報に関する開示

計測日時：2024年9月30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になります。

【計算式】  $(\text{未カバーポジション}^{(注1)} / |\text{お客様の買い建玉} - \text{お客様の売り建玉}|) \times 100$

(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になります。

【各区分の計算式】

$(\text{各区分のカバー取引先における買建玉と売建玉の合計} / \text{全カバー取引先における買建玉と売建玉の合計}) \times 100$

|           |     |
|-----------|-----|
| 【BBB以上】   | 57% |
| 【BBB未満】   | 0%  |
| 【格付なし】 ※1 | 43% |

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】  $\text{実預託額} / (\text{お客様の買い建玉} + \text{お客様の売り建玉}) \times 100$

|        |     |
|--------|-----|
| 平均証拠金率 | 26% |
|--------|-----|

店頭F×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×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