

店頭FX取引に係るリスク情報に関する開示

FOREX EXCHANGE 株式会社

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。

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しております。

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

(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

2020/10/31	0%
2020/11/30	0%
2020/12/31	0%

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。

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しております。

【各区分の計算式】

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

2020/10/31	【格付なし】	100%
2020/11/30	【格付なし】	100%
2020/12/31	【格付なし】	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。

取引終了時点で計測しております。

【計算式】 $\text{実預託額} / (\text{顧客の買い建玉} + \text{顧客の売り建玉}) \times 100$

2020/10/31	44.6%
2020/11/30	21.6%
2020/12/31	86.7%

(参考)

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