

店頭FX取引に係るリスク情報に関する開示について

あい証券株式会社

計測日時: 2023年6月30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】 $(\text{未カバーポジション}^{(注)} \div |\text{顧客の買い建玉} - \text{顧客の売り建玉}|) \times 100$

(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

未カバー率
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。

【各区分の計算式】

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

全通貨ペア

【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。

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

年月日	平均証拠金率
2023年6月30日	11.17%

(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