

## 店頭FX取引に係るリスク情報に関する開示

店頭FX取引を行う金融商品取引業者等は、お客さまや取引先に特定通貨関連店頭デリバティブ取引に係るリスク情報を提供するため、法令等に基づき、2019年9月より、月末時点の下記項目を開示することが義務付けられました。

計測日時	未カバー率 ※1	カバー取引の状況 ※2		平均証拠金率 ※3
		格付	割合	
2019年9月30日	0%	格付なし	100%	20%

### 項目説明

#### ※1 未カバー率

店頭FX取引の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。数値が高いほどFX業者の事業リスクが高くなります。当社では、お客さまのポジションはすべて即時にカバーしているため、通常において未カバーポジションは発生いたしません。

計算式：
$$\frac{\text{（未カバーポジション）} \div \text{（顧客の買い建玉 - 顧客の売り建玉）} \times 100}{\text{未カバーポジションとは、顧客の建玉のうち、顧客の建玉同士で売り買いが対当しておらず、かつ、カバーされていない顧客の建玉の合計}}$$

#### ※2 カバー取引の状況

カバー取引先が破綻した場合には、お客さまのポジションに係る再構築コスト等が発生する可能性があります。当社では、グループ子会社SBIリクイディティ・マーケット株式会社（以下、SBILM）に100%カバーしております。SBILMは、当社を含む外国為替証拠金取引業者との取引を通じ、国内外の信用度の高い複数の大手金融機関（カウンターパーティ）にカバー取引を行うことでリスクを分散しております。当社と同様に、リスク情報に関する開示を行っておりますので、詳細は下記ページをご確認下さい。

SBIリクイディティ・マーケット株式会社 事業概要

<https://www.sbilm.co.jp/business/>

SBIリクイディティ・マーケット株式会社 店頭FX取引に係るリスク情報に関する開示

<https://www.sbilm.co.jp/disclosure/>

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

格付について  
信用格付（金融庁長官が指定する者が付与するものに限る）に応じて当該項目を公表することとされています。  
カバー先であるSBIリクイディティ・マーケット株式会社は、無格付ですが、100%連結親会社である当社は、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おります。

詳細は、下記ページをご確認下さい。

株式会社格付投資情報センター（R&I）

<https://www.r-i.co.jp/rating/issuers/007100/8701/index.html>

#### ※3 平均証拠金率

店頭FX取引の証拠金率が低い場合には、FX業者の顧客未収金リスクが大きくなりFX業者の事業リスクが高くなります。

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