

店頭FX取引に係るリスク情報に関する開示

計測日時 2021年7月30日

未カバーの状況 ➤ 顧客（当グループFX取引会社）からの売買注文をカウンターパーティ（銀行等）へカバー取引していない状況。
カバーされていないポジション（売買注文）は、為替相場の変動の影響を直接受けることになります

未カバー率
0.48621% 単位未満を四捨五入

【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

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。

格付付与：S&Pグローバル・レーティング

【 AA- 】	【 A+ 】	【 A 】
1.1%	24.2%	50.3%
【 A- 】	【 BBB+ 】	【 BBB 】
13.6%	10.8%	0.0%

※ その他格付けなし 0.0% 全て投資適格となっております。

【各区分の計算式】

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

当社 カバー取引先カウンターパーティ：31社

詳細はこちら https://www.sbilm.co.jp/ja/company?section=counter_party