

店頭FX取引に係るリスク情報に関する開示

計測日時 2024年2月29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 |
| 1.61168% 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 】 |
| 1.7% | 57.5% | 35.4% |
| 【 A- 】 | 【 BBB+ 】 | 【 BBB 】 |
| 4.5% | 0.9% | 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】

(各区分のカバー取引先における買建玉と売建玉の合計 / 全カバー取引先における買建玉と売建玉の合計) × 100

当社 カバー取引先カウンターパーティ：32社

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