

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3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
0.31140% 単位未満を四捨五入

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

(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 】
1.2%	44.8%	50.3%
【 A－ 】	【 BBB＋ 】	【 BBB 】
2.1%	1.5%	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】

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

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