

各位

フィリップ証券株式会社

店頭FX取引に係るリスク情報に関する開示事項

計測日時：2019年12月31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となります。

【計算式】 $(\text{未カバーポジション}^{(注)} / |\text{お客様の買い建玉} - \text{お客様の売り建玉}|) \times 100$

(注)お客様の建玉のうち、お客様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お客様の建玉

未カバー率
1.22 %

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となります。

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

【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】 $\text{実預託額} / (\text{お客様の買い建玉} + \text{お客様の売り建玉}) \times 100$

平均証拠金率
9.13 %

(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います。

以上