

## 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10月末

イ. 当社は全取引を英国親会社(IG Group Holdings plc)の子会社であるIG Markets Limitedとの間でリアルタイムでカバーしているため、未カバー率は常に0%です。

ロ. 上記の通り、当社の唯一のカバー先は英国親会社の子会社であるIG Markets Limitedです。

ハ. 平均証拠金率は、取引終了時点で計測しています。

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になります。

$$\left[ \begin{array}{l} \text{【計算式】} \quad (\text{未カバーポジション}^{(\text{注})} / |\text{顧客の買い建玉} - \text{顧客の売り建玉}|) \times 100 \\ \text{(注) 顧客の建玉のうち、顧客の建玉同士で売り買いが対当しておらず、かつ、カバーされていない顧客の建玉} \end{array} \right]$$

未カバー率
0%

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になります。

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

IG Markets Limited (BBB-)
100%

(注) カバー先であるIG Markets Limitedは、当社を含むIGグループの持株会社であるIG Group Holdings plcとともにFitch Ratingsより発行体デフォルト格付BBB- (安定的)を取得しております。

また、IG Markets Limitedは日本を含む世界中の建玉をJP Morgan Chase, UBS等の優良格付けを有する取引先との間でカバーしております。

なお、以下は2021年5月期IG Group Holdings plcのアンニュアルレポートからの抜粋です。(原文は英語です: Risk Management - Business model risk - Market risk)

IGは自己ポジションの保有により積極的に市場リスクをとることによる収益機会を追求いたしません。従ってIGの収益は市場の動向に依存するものではありません。

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。

$$\left[ \begin{array}{l} \text{【計算式】} \quad \text{実預託額} / (\text{顧客の買い建玉} + \text{顧客の売り建玉}) \times 100 \end{array} \right]$$

平均証拠金率
26.2%

(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おります。

以 上