

FMI原則に基づく定量的な情報開示

原則4 信用リスク

(単位：百万円)

Ref.No.	開示項目			算出期間		TFXの清算対象商品			注記	
	開示すべき内容			算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引		
4.1.1	事前拋出型の財務資源 (除く証拠金)	清算機関が拋出	清算参加者負担前に充当される額	2016/9/30	2016/9/30	1,000	1,569	94		
4.1.2			清算参加者負担と同時に充当される額			0	1,631	306		
4.1.3			清算参加者負担後に充当される額			0	0	0		
4.1.4		清算参加者が拋出	清算預託金所要額			2,236	21,842	381		
4.1.5			清算預託金預託額			6,486	25,146	1,002		
4.1.6			その他			0	0	0		
4.1.7	事後拋出型の(コミットされた)財務資源 (除く証拠金)	清算機関が拋出	破綻に充当される額	2016/9/30	2016/9/30	0	0	0		
4.1.8			清算参加者が拋出			最初の破綻に充当される額	0	22,724		1,252
4.1.9		連鎖破綻に充当される額				上限なし	上限なし	上限なし		
4.1.10		その他	0			0	0			
4.2.1	KCCP	銀行の清算機関向けエクスポージャーに対する資本賦課		2016/9/30	2016/9/30	42	0	0		
4.3.1	事前拋出型財務資源 (除く証拠金)	現金	該当通貨の中央銀行に預託された現金	2016/9/30	2016/9/30	-	-	-	(4.3.3)の「商業銀行に預託された現金(元本保証型預金)」は、満期保有時に元本が保証された預金。(元本割れリスクのない普通預金、定期預金等)	
4.3.2			他の中央銀行に預託された現金			-	-	-		
4.3.3			商業銀行に預託された現金(元本保証型預金)			3,031	21,859	1,205		
4.3.4			商業銀行に預託された現金(元本非保証型預金)			0	0	0		
4.3.5			非現金			国債	2,241	6,422		80
4.3.6						外債	2,206	6,352		80
4.3.7						政府機関債	0	0		0
4.3.8						地方債	0	0		0
4.3.9						社債	0	0		0
4.3.10			株式			3,215	194	168		
4.3.11		コモディティ(金)	2,249			135	117			
4.3.12		コモディティ(その他)	-			-	-			
4.3.13		ミューチュアルファンド	-			-	-			
4.3.14		その他	-			-	-			
4.3.15		合計	8,487			28,475	1,453			
4.4.1	信用エクスポージャー	想定損失額の算出要件	想定破綻先数	2015/10/1	2016/9/30	4社	3社	2社	(4.4.1)TFXの想定破綻先数は、TFXに対して信用リスク額が最大となる清算参加者1社および財務的に脆弱な清算参加者(金利先物等取引は3社、取引所為替証拠金取引は2社、取引所株価指数証拠金取引は1社)としている。	
4.4.2			クローズアウト期間			1日	1日	1日		
4.4.3			想定損失額(想定破綻先上位1社+関係会社)			想定損失残額(証拠金差引後)	3,300	47,744		6,308
4.4.4						平均	2,136	19,330		2,379
4.4.5			想定損失残額(証拠金差引後)(注)が事前拋出財務資源額を超過した日数			想定損失残額(証拠金差引後)(注)が事前拋出財務資源額を超過した金額	0日	8日		0日
4.4.6		実際に発生した損失残額(証拠金差引後)				最大値	-	18,361		-
4.4.7						平均	-	18,226		-
4.4.8						最大値	-	3,171		-
4.4.9						平均	-	3,037		-
4.4.10			最大値			-	2,582	-		
4.4.11	平均	-	2,574	-						
4.4.12	最大値	-	1,563	-						
4.4.13	平均	-	1,502	-						
4.4.14	最大値	-	-	-						
4.4.15	平均	-	-	-						
4.4.16	最大値	-	-	-						
4.4.17	平均	-	-	-						
4.4.18	最大値	-	-	-						
4.4.19	平均	-	-	-						
4.4.20	最大値	-	-	-						
4.4.21	平均	-	-	-						
4.4.22	最大値	-	-	-						
4.4.23	平均	-	-	-						
4.4.24	最大値	-	-	-						
4.4.25	平均	-	-	-						
4.4.26	最大値	-	-	-						
4.4.27	平均	-	-	-						
4.4.28	最大値	-	-	-						
4.4.29	平均	-	-	-						
4.4.30	最大値	-	-	-						
4.4.31	平均	-	-	-						
4.4.32	最大値	-	-	-						
4.4.33	平均	-	-	-						
4.4.34	最大値	-	-	-						
4.4.35	平均	-	-	-						
4.4.36	最大値	-	-	-						
4.4.37	平均	-	-	-						
4.4.38	最大値	-	-	-						
4.4.39	平均	-	-	-						
4.4.40	最大値	-	-	-						
4.4.41	平均	-	-	-						
4.4.42	最大値	-	-	-						
4.4.43	平均	-	-	-						
4.4.44	最大値	-	-	-						
4.4.45	平均	-	-	-						
4.4.46	最大値	-	-	-						
4.4.47	平均	-	-	-						
4.4.48	最大値	-	-	-						
4.4.49	平均	-	-	-						
4.4.50	最大値	-	-	-						
4.4.51	平均	-	-	-						
4.4.52	最大値	-	-	-						
4.4.53	平均	-	-	-						
4.4.54	最大値	-	-	-						
4.4.55	平均	-	-	-						
4.4.56	最大値	-	-	-						
4.4.57	平均	-	-	-						
4.4.58	最大値	-	-	-						
4.4.59	平均	-	-	-						
4.4.60	最大値	-	-	-						
4.4.61	平均	-	-	-						
4.4.62	最大値	-	-	-						
4.4.63	平均	-	-	-						
4.4.64	最大値	-	-	-						
4.4.65	平均	-	-	-						
4.4.66	最大値	-	-	-						
4.4.67	平均	-	-	-						
4.4.68	最大値	-	-	-						
4.4.69	平均	-	-	-						
4.4.70	最大値	-	-	-						
4.4.71	平均	-	-	-						
4.4.72	最大値	-	-	-						
4.4.73	平均	-	-	-						
4.4.74	最大値	-	-	-						
4.4.75	平均	-	-	-						
4.4.76	最大値	-	-	-						
4.4.77	平均	-	-	-						
4.4.78	最大値	-	-	-						
4.4.79	平均	-	-	-						
4.4.80	最大値	-	-	-						
4.4.81	平均	-	-	-						
4.4.82	最大値	-	-	-						
4.4.83	平均	-	-	-						
4.4.84	最大値	-	-	-						
4.4.85	平均	-	-	-						
4.4.86	最大値	-	-	-						
4.4.87	平均	-	-	-						
4.4.88	最大値	-	-	-						
4.4.89	平均	-	-	-						
4.4.90	最大値	-	-	-						
4.4.91	平均	-	-	-						
4.4.92	最大値	-	-	-						
4.4.93	平均	-	-	-						
4.4.94	最大値	-	-	-						
4.4.95	平均	-	-	-						
4.4.96	最大値	-	-	-						
4.4.97	平均	-	-	-						
4.4.98	最大値	-	-	-						
4.4.99	平均	-	-	-						
4.4.100	最大値	-	-	-						
4.4.101	平均	-	-	-						
4.4.102	最大値	-	-	-						
4.4.103	平均	-	-	-						
4.4.104	最大値	-	-	-						
4.4.105	平均	-	-	-						
4.4.106	最大値	-	-	-						
4.4.107	平均	-	-	-						
4.4.108	最大値	-	-	-						
4.4.109	平均	-	-	-						
4.4.110	最大値	-	-	-						
4.4.111	平均	-	-	-						
4.4.112	最大値	-	-	-						
4.4.113	平均	-	-	-						
4.4.114	最大値	-	-	-						
4.4.115	平均	-	-	-						
4.4.116	最大値	-	-	-						
4.4.117	平均	-	-	-						
4.4.118	最大値	-	-	-						
4.4.119	平均	-	-	-						
4.4.120	最大値	-	-	-						
4.4.121	平均	-	-	-						
4.4.122	最大値	-	-	-						
4.4.123	平均	-	-	-						
4.4.124	最大値	-	-	-						
4.4.125	平均	-	-	-						
4.4.126	最大値	-	-	-						
4.4.127	平均	-	-	-						
4.4.128	最大値	-	-	-						
4.4.129	平均	-	-	-						
4.4.130	最大値	-	-	-						
4.4.131	平均	-	-	-						
4.4.132	最大値	-	-	-						
4.4.133	平均	-	-	-						
4.4.134	最大値	-	-	-						
4.4.135	平均	-	-	-						
4.4.136	最大値	-	-	-						
4.4.137	平均	-	-	-						
4.4.138	最大値	-	-	-						
4.4.139	平均	-	-	-						
4.4.140	最大値	-	-	-						
4.4.141	平均	-	-	-						
4.4.142	最大値	-	-	-						
4.4.143	平均	-	-	-						
4.4.144	最大値	-	-	-						
4.4.145	平均	-	-	-						
4.4.146	最大値	-	-	-						
4.4.147	平均	-	-	-						
4.4.148	最大値	-	-	-						
4.4.149	平均	-	-	-						
4.4.150	最大値	-	-	-						
4.4.151	平均	-	-	-						
4.4.152	最大値	-	-	-						
4.4.153	平均	-	-	-						
4.4.154	最大値	-	-	-						
4.4.155	平均	-	-	-						
4.4.156	最大値	-	-	-						
4.4.157	平均	-	-	-						
4.4.158	最大値	-	-	-						
4.4.159	平均	-	-	-						
4.4.160	最大値	-	-	-						
4.4.161	平均	-	-	-						
4.4.162	最大値	-	-	-						
4.4.163	平均	-	-	-						
4.4.164	最大値	-	-	-						
4.4.165	平均	-	-	-						
4.4.166	最大値	-	-	-						
4.4.167	平均	-	-	-						
4.4.168	最大値	-	-	-						
4.4.169	平均	-	-	-						
4.4.170	最大値	-	-	-						
4.4.171	平均	-	-	-						
4.4.172	最大値	-	-	-						
4.4.173	平均	-	-	-						
4.4.174	最大値	-	-	-						
4.4.175	平均	-	-	-						
4.4.176	最大値	-	-	-						
4.4.177	平均	-	-	-						
4.4.178	最大値	-	-	-						
4.4.179	平均	-	-	-						
4.4.180	最大値	-	-	-						
4.4.181	平均	-	-	-						
4.4.182	最大値	-	-	-						
4.4.183	平均	-	-	-						
4.4.184	最大値	-	-	-						
4.4.185	平均	-	-	-						
4.4.186	最大値	-	-	-						
4.4.187	平均	-	-	-						
4.4.188	最大値	-	-	-						
4.4.189	平均	-	-	-						
4.4.190	最大値	-	-	-						
4.4.191	平均	-	-	-						
4.4.192	最大値	-	-	-						
4.4.193	平均	-	-	-						
4.4.194	最大値	-	-	-						
4.4.195	平均	-	-	-						
4.4.196	最大値	-	-	-						
4.4.197	平均	-	-	-						
4.4.198	最大値	-	-	-						
4.4.199	平均	-	-	-						
4.4.200	最大値	-	-	-						
4.4.201	平均	-	-	-						
4.4.202	最大値	-	-	-						
4.4.203	平均	-	-	-						
4.4.204	最大値	-	-	-						
4.4.205	平均	-	-	-						
4.4.206	最大値	-	-	-						
4.4.207	平均	-	-	-						
4.4.208	最大値	-	-	-						
4.4.209	平均	-	-	-						
4.4.210	最大値	-	-	-						
4.4.211	平均	-	-	-						
4.4.212	最大値	-	-	-						
4.4.213	平均	-	-	-						
4.4.214	最大値	-	-	-						
4.4.215	平均	-	-	-						
4.4.216	最大値	-	-	-						
4.4.217	平均	-	-	-						
4.4.218	最大値	-	-	-						
4.4.219	平均	-	-							

原則5 担保

Ref.No.	開示項目			算出期間		TFXの清算対象商品			注記	
	開示すべき内容			算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引		
5.1.1	担保	掛け目	当初証拠金に関する記載	-	-	http://www.tfx.co.jp/rules/document/a1a09.pdf				
5.2.1			清算預託金の代用有価証券に関する記載			http://www.tfx.co.jp/rules/document/a7a02.pdf				
5.3.1		カバー水準	2016/7/1			2016/9/30	100%	100%		100%
5.3.2		担保の掛け目の想定保有期間					4日	4日		4日
5.3.3		データ参照期間					1年	1年		1年
5.3.4	想定保有期間において掛け目を超過して価値が下落した日数	0日		0日	0日					

原則6 証拠金

(単位：百万円)

Ref.No.	開示項目			算出期間		TFXの清算対象商品			注記
	開示すべき内容			算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
6.1.1	証拠金所要額	証拠金所要額の総額		2016/9/30	2016/9/30	998	10,354	1,999	(6.1.1) 取引所為替証拠金取引および取引所株価指数証拠金取引の証拠金所要額については、当初証拠金と変動証拠金を合算して管理している。
		自己分(ネット)	-			55,149	3,049		
		受託分(グロス)	2,780			-	-		
		受託分(ネット)	3,777			65,502	5,047		
		合計	-			-	-		
6.2.1	証拠金預託額	該当通貨の中央銀行に預託された現金				-	-	-	(6.1.1~6.2.15) 取引所為替証拠金取引および取引所株価指数証拠金取引の証拠金所要額については、証拠金はすべて現金担保としている。
		自己当初証拠金(時価)	-	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	-	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	-	-	-				
6.2.2		他の中央銀行に預託された現金				-	-	-	(6.2.3)の「商業銀行に預託された現金(元本保証型預金)」は、満期保有時に元本が保証された預金。(元本割れリスクのない普通預金、定期預金等)
		自己当初証拠金(時価)	-	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	-	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	-	-	-				
6.2.3	商業銀行に預託された現金	元本保証型預金	自己当初証拠金(時価)	3,614	114,293	16,554			
			自己当初証拠金(評価額)	3,614	114,293	16,554			
			受託当初証拠金(時価)	5,085	259,245	35,897			
			受託当初証拠金(評価額)	5,085	259,245	35,897			
			当初証拠金合計(時価)	8,698	373,538	52,452			
6.2.4		元本非保証型預金	当初証拠金合計(評価額)	8,698	373,538	52,452			
		自己当初証拠金(時価)	-	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	-	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	-	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	-	-	-				
6.2.5	国債	自己当初証拠金(時価)	11,793	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	11,614	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	2,504	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	2,458	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	14,297	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	14,071	-	-				
6.2.6	外債	自己当初証拠金(時価)	0	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	0	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	0	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	0	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	0	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	0	-	-				
6.2.7	政府機関債	自己当初証拠金(時価)	0	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	0	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	0	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	0	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	0	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	0	-	-				
6.2.8	地方債	自己当初証拠金(時価)	0	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	0	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	0	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	0	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	0	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	0	-	-				
6.2.9	社債	自己当初証拠金(時価)	0	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	0	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	0	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	0	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	0	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	0	-	-				
6.2.10	株式	自己当初証拠金(時価)	17,450	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	12,206	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	414	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	290	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	17,864	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	12,495	-	-				
6.2.11	コモディティ(金)	自己当初証拠金(時価)	-	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	-	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	-	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	-	-	-				
6.2.12	コモディティ(その他)	自己当初証拠金(時価)	-	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	-	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	-	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	-	-	-				
6.2.13	ミューチュアルファンド	自己当初証拠金(時価)	-	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	-	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	-	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	-	-	-				
6.2.14	その他	自己当初証拠金(時価)	-	-	-				
		自己当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		受託当初証拠金(時価)	-	-	-				
		受託当初証拠金(評価額)	-	-	-				
		当初証拠金合計(時価)	-	-	-				
		当初証拠金合計(評価額)	-	-	-				

6.2.15		合計	自己当初証拠金(時価)			32,857	114,293	16,554	
			自己当初証拠金(評価額)			27,433	114,293	16,554	
			受託当初証拠金(時価)			8,002	259,245	35,897	
			受託当初証拠金(評価額)			7,832	259,245	35,897	
			当初証拠金合計(時価)			40,859	373,538	52,452	
			当初証拠金合計(評価額)			35,265	373,538	52,452	
6.3.1	証拠金の基準レート	証拠金の基準レートに関する記載		-	-	http://www.tfx.co.jp/cgi-bin/param_j.cgi	http://www.clic365.jp/fx/fxmargin.shtml http://www.clic365.jp/wholesale/fxmargin_c.shtml	http://www.clic365.jp/cfd/service/margin.shtml	
6.4.1	証拠金算出モデル	当初証拠金算出モデルのタイプ		2016/9/30	2016/9/30	SPAN方式	固定倍率(レバレッジ)方式	ヒストリカルボラティリティ方式	(6.4.1) 取引所為替証拠金取引について、個人顧客による取引は、金商法令に定められたレバレッジ倍率25倍に基づいて、証拠金基準額を算定している。取引参加者及び法人顧客については、取引所規則に従い、取引対象通貨によってレバレッジ上限倍率 150 倍又は 25 倍を基準として、証拠金基準額を算定している。
6.4.2		モデルタイプの変更日				1996/4/8	2011/8/1	2013/8/5	
6.4.3		モデル名				SPAN@	-	-	
6.4.4		モデル名の変更日				-	-	-	
6.4.5		信頼水準				99%	(注)	99%	(注) (6.4.5) 個人顧客による取引は、金商法令に定められた、レバレッジ上限倍率 25 倍に基づいて証拠金基準額を算定している。このレバレッジ倍率は、少なくとも主要 3 通貨(米ドル/円、ユーロ/円、豪ドル/円)について、ストレステストに用いている価格変動データにおける信頼水準99%以上を十分カバーしていることを確認している。
6.4.6		信頼水準の変更日				(注)	(注)	(注)	(注) (6.4.6、6.4.8、6.4.10、
6.4.7		データ参照期間				6カ月	個人顧客：1週間 法人顧客：4週間	24週間	6.4.12、6.4.15)
6.4.8		計算対象期間の変更日				(注)	(注)	(注)	2015年7月に新たな財務資源制度を導入以降、リスク管理体制全般の妥当性検証
6.4.9		ヒストリカルデータへの修正点等				-	-	-	の一環として年1回見直しをしていくルールとしている。
6.4.10		修正等に関する変更日				(注)	(注)	(注)	
6.4.11		クローズアウト期間				1日	1日	1日	
6.4.12		クローズアウト期間の変更日				(注)	(注)	(注)	
6.4.13		当初証拠金レートに関するリンク先				http://www.tfx.co.jp/cgi-bin/param_j.cgi	http://www.clic365.jp/fx/fxmargin.shtml http://www.clic365.jp/wholesale/fxmargin_c.shtml	http://www.clic365.jp/cfd/service/margin.shtml	
6.4.14		パラメーターレビューの頻度				1カ月毎	個人顧客：1週間 毎 法人顧客：1カ月 毎	1週間毎	
6.4.15		パラメーターレビューの頻度の変更日				(注)	(注)	(注)	
6.5.1.1	証拠金バックテスト	過去12カ月間に差金額が証拠金所要額を超過した回数		2015/10/1	2016/9/30	2回	26回	4回	(6.5.4、6.5.5)参加者毎に実施したバックテスト結果について、差金額が証拠金所要額を超過した額の最大値・平均値を表示。
6.5.1.2		バックテスト結果測定頻度				1回/日	1回/日	1回/日	
6.5.1.3		バックテスト結果測定時刻				17:00:00	6:00:00	6:00:00	
6.5.2		サンプル数				245日	261日	261日	
6.5.3		充足率				99.2%	90.0%	98.5%	
6.5.4		証拠金超過額の最大額(年間)	最大値			379	14,656	653	
6.5.5		証拠金超過額の平均額(年間)	平均			78	1,036	129	
6.6.1	変動証拠金	差金合計(1日あたり平均)	平均	2016/7/1	2016/9/30	135	3,519	305	
6.7.1		差金合計(1日あたり最大)	最大値			1,516	14,764	1,957	
6.8.1		追加証拠金必要額(1日あたり最大)				111	305	40	

開示項目				算出期間		TFXの清算対象商品			注記		
				算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引			
7.1.1	資金流動性 リスク	流動的な資産がカバーす べき対象	想定破綻先数	2016/9/30	2016/9/30	4社	3社	2社	(7.1.1) 想定破綻先数については、TFX に対して信用リスク額が最大となる清算 参加者1社および財務的に脆弱な清算参加 者（金利先物等取引は3社、取引所為替証 拠金取引は2社、取引所株価指数証拠金取 引は1社）としている。 (7.1.4)の「商業銀行に預託された現金 (元本保証型預金)」は、満期保有時に 元本が保証された預金。(元本割れリス クのない普通預金、定期預金等) (7.1.7) TFXの流動性供給枠は、決済銀 行として指定した複数の商業銀行に設け ており、TFXは契約に基づく手続きを取 ることにより資金を当日利用することが 可能。 (7.1.10) 日本銀行に決済目的で当座預 金口座を開設。		
7.1.2		適格流動性資源の額	該当通貨を発行する中央 銀行に預託する現金			0	0	0			
7.1.3			他の中央銀行に預託する 現金			0	0	0			
7.1.4			商業銀行に預託された現 金（元本保証型預金）			0	114,103	32,557			
7.1.5			商業銀行に預託された現 金（元本非保証型預金）			0	0	0			
7.1.6			流動性供給枠（有担保）			0	0	0			
7.1.7			流動性供給枠（無担保）			29,000	0	0			
7.1.8			ストレス時においても事 前の取極めにより換金可 能な流動性の高くカスト ディに預託された担保			0	0	0			
7.1.9			その他の流動性調達			0	0	0			
7.1.10			流動性資源への定期的な アクセス			アクセスはない。					
7.1.11			流動性資源の使用順位	意思決定に必要なガバ ナンス・規則・方法を記載		http://www.tfx.co.jp/rules/document/a1a08.pdf					
7.2.1	補助的な流 動性資源	補助的な流動性資源の額 等		-	-			6,284			
7.3.1	資金流動性 リスク	ストレス時に必要な流動 性の額（上位1社破綻を 想定・四半期最大値）	当日の決済額	当日決済額合計	2015/10/1	2016/9/30	4,116	56,785	10,622	(7.3.5~7.3.7) TFXは外貨決済を行っ ていない。	
			日中に支払が必要な額	日中支払額合計			-	-	-		
			日を跨いで決済する額	日過ぎ決済額合計			-	-	-		
				当日決済額			4,116	56,785	10,622		
				日中支払額			-	-	-		
				日過ぎ決済額			-	-	-		
7.3.2			流動性資源が不足した日					0	0		0
7.3.3			流動性資源が不足した際 の金額					0	0		0
7.3.4		実際に発生した流動性必要額（上位1社破綻を想定） (注)		当日の決済額			当日決済額合計	565	49,396		4,970
				日中に支払が必要な額			日中支払額合計	-	-		-
				日を跨いで決済する額			日過ぎ決済額合計	-	-		-
							当日決済額	565	49,396		4,970
							日中支払額	-	-		-
7.3.5		ストレス時に必要な流動 性の額（関連通貨（外貨 建）・上位1社破綻を想 定・四半期最大値）		当日の決済額				-	-		-
	日中に支払が必要な額				-	-	-				
	日を跨いで決済する額				-	-	-				
	流動性資源が不足した日				-	-	-				
7.3.6		流動性資源が不足した際 の金額			-	-	-				
7.3.7					-	-	-				

原則13 参加者破綻処理

開示項目				算出期間		TFXの清算対象商品			注記
Ref.No.	開示すべき内容			算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
13.1.1	清算参加者	清算参加者破綻時の損失額と証拠金		2016/7/1	2016/9/30	-	-	-	
13.1.2	破綻時の情 報開示	損失補填をするために使用された清算預託金				-	-	-	
13.1.3.1		破綻に関する定量情報（当初証拠金額に対する損失 額）				-	-	-	
13.1.3.2		破綻に関する定量情報（移管された顧客建玉の割 合）				-	-	-	
13.1.4		清算参加者破綻後の情報開示				-	-	-	

原則14 分別管理

開示項目				算出期間		TFXの清算対象商品			注記
Ref.No.	開示すべき内容			算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
14.1.1	口座種別の 割合	個別口座		2016/9/30	2016/9/30	0%	100%	100%	
14.1.2		オムニバス口座				100%	0%	0%	
14.1.3		LSOC口座				0%	0%	0%	
14.1.4		自己受託合同口座				0%	0%	0%	

原則15 ビジネスリスク

開示項目				算出期間		TFXの清算対象商品			注記
Ref.No.	開示すべき内容			算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
15.1.1	財務項目	流動的な純資産		2015/4/1	2016/3/31			16,966	(15.1.2) 以下を控除した「営業費用の 6カ月分に相当する額」を記載 1.減価償却費 2.取引所為替証拠金取引におけるマー ケットメイカーからの定率手数料のう ち、一定の割合を取引奨励金として取引 参加者に支払っているため、決算書上の 営業収益、営業費用は当該取引振興料を 含んでいるところ、その取引振興料の額 (4,158百万円) (注) (15.2.6) 取引参加者預り金（現 金）は、B/S上に含まれている。取引参 加者預り金（非現金）はB/S上に含まれ ていない。 (15.3.1) TFXは取引手数料と清算手 料の区分を設けていない。
15.1.2		営業費用の6カ月分						1,684	
15.2.1		営業収益		2015/4/1	2016/3/31			9,316	
15.2.2		営業費用						9,158	
15.2.3		営業損益						158	
15.2.4		総資産						559,647	
15.2.5		負債合計						538,379	
15.2.6		取引参加者預り金						(注)	
15.2.7		特記事項						-	
15.3.1		営業収益に対する手数料収入の割合		2015/4/1	2016/3/31			87.89%	
15.3.2	営業収益に対する資産管理運用収入の割合						4.80%		

Ref.No.	開示項目		算出期間		TFXの清算対象商品			注記
	開示すべき内容		算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
16.1.1	現金担保預	証拠金	2016/9/30	2016/9/30	8,698	373,538	52,452	(16.2.4)の「商業銀行に預託された現金(元本保証型預金)」は、満期保有時に元本が保証された預金。(元本割れリスクのない普通預金、定期預金等) (注)(16.2.9)金利先物等取引の清算参加者が預託している現金担保は、全て商業銀行の普通預金(決済性)で管理している。 (16.2.10~16.2.20)清算参加者から預託された現金は、全て銀行預金で管理しており、一切、有価証券に投資していない。
16.1.2	り額	清算預託金			2,031	18,659	805	
16.2.1	預り額の内	清算参加者から預けられた現金担保のうち、現金として保有している割合	2016/9/30	2016/9/30	100%	100%	100%	
16.2.2		中央銀行			0%	0%	0%	
16.2.3		他の中央銀行			0%	0%	0%	
16.2.4		商業銀行(元本保証型預金)			100%	100%	100%	
16.2.5		商業銀行(元本非保証型預金)			0%	0%	0%	
16.2.6		MMF			0%	0%	0%	
16.2.7		その他			0%	0%	0%	
16.2.8		通貨(日本円)			100%	100%	100%	
16.2.9		現金比率			100%	100%	100%	
		平均残存期間			(注)	0.38年	0.39年	
16.2.10		清算参加者から預けられた現金担保のうち有価証券に投資している割合			-	-	-	
16.2.11		国内債			-	-	-	
16.2.12		外国債			-	-	-	
16.2.13		政府機関債			-	-	-	
16.2.14		地方債			-	-	-	
16.2.15		その他債券			-	-	-	
16.2.16		通貨ごとの有価証券			-	-	-	
16.2.17		証券投資における清算参加者の現金の総額の割合、加重平均満期等			-	-	-	
16.2.18		投資ポートフォリオに係るリスク推定値			-	-	-	
16.2.19		単一の投資先に対する投資割合の制限及び限度額に関するポリシー			-	-	-	
16.2.20		前四半期における限度額を超過した日数			-	-	-	
16.3.1	資産再担保	有価証券で保有されている割合	2016/9/30	2016/9/30	0%	0%	0%	(16.3)清算参加者から預託された非現金担保は、一切、有価証券貸借取引等の担保(再担保)に利用していない。
16.3.2	(非現金)	非現金再担保総額(当初証拠金)			-	-	-	
16.3.3		非現金再担保総額(清算預託金)			-	-	-	
16.3.4		非現金再担保のマチュリティー別の配分状況(当初証拠金)			-	-	-	
		非現金再担保のマチュリティー別の配分状況(清算預託金)			-	-	-	

Ref.No.	開示項目		算出期間		TFXの清算対象商品			注記
	開示すべき内容		算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
17.1.1	システムの	システムの安定稼働目標	-	-	100%	100%	100%	
17.2.1	安定稼働目	システムの安定稼働実績	2015/10/1	2016/9/30	100%	100%	100%	
17.3.1	標	システム障害の発生頻度・継続時間			0回	0回	0回	
17.4.1		システム障害時の復旧目標時間	-	-	2時間	2時間	2時間	

Ref.No.	開示項目		算出期間		TFXの清算対象商品			注記
	開示すべき内容		算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
18.1.1.1	清算参加者	総合清算参加者(自社及び他社清算)	2016/9/30	2016/9/30	30社	0社	0社	
18.1.1.2	数	直接清算参加者(自社清算のみ)			0社	22社	13社	
18.1.1.3		その他カテゴリの清算参加者			0社	0社	0社	
18.1.2.1		中央銀行			0社	0社	0社	
18.1.2.2		清算機関			0社	0社	0社	
18.1.2.3		銀行			13社	4社	0社	
18.1.2.4		その他カテゴリ業種			17社	18社	13社	
18.1.3.1		国内			29社	20社	13社	
18.1.3.2		海外			1社	2社	0社	
18.2.1	建玉の上位	清算参加者25社未満：上位5社の建玉シェア	2016/7/1	2016/9/30	-	80%	85%	
	集中度	最大値			-	77%	83%	
		平均			68%	-	-	
18.2.2		清算参加者25社以上：上位5社の建玉シェア			63%	-	-	
		最大値			94%	-	-	
		平均			91%	-	-	
18.3.1	証拠金の上位	清算参加者25社未満：上位5社の証拠金シェア	2016/7/1	2016/9/30	-	83%	77%	
	集中度	最大値			-	82%	75%	
		平均			60%	-	-	
18.3.2		清算参加者25社以上：上位5社の証拠金シェア			59%	-	-	
		最大値			82%	-	-	
		平均			80%	-	-	
18.4.1	清算預託金	清算参加者25社未満：上位5社の清算預託金シェア	2016/9/30	2016/9/30	-	82%	77%	
18.4.2	の上位集中	清算参加者25社以上：上位5社の清算預託金シェア			32%	-	-	
18.4.3	度	清算参加者25社以上：上位10社の清算預託金シエ			52%	-	-	

Ref.No.	開示項目		算出期間		TFXの清算対象商品			注記
	開示すべき内容		算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
19.1.1	顧客の集中	顧客の数(口座数)	2016/7/1	2016/9/30	-	756,010口座	57,679口座	
19.1.2	度合い	受託取引を行う清算参加者の数			30社	17社	12社	
19.1.3.1		清算参加者10社以上：清算参加者上位5社の顧客の			98%	86%	92%	
19.1.3.2		取引シェア			87%	79%	85%	
19.1.4.1		清算参加者25社以上：清算参加者上位10社の顧客			100%	-	-	
19.1.4.2		の取引シェア			100%	-	-	

Ref.No.	開示項目		算出期間		TFXの清算対象商品			注記
	開示すべき内容		算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	取引所為替 証拠金取引	取引所株価指数 証拠金取引	
23.1.1	市場データ	取引枚数	2016/7/1	2016/9/30	8,254枚	167,324枚	23,164枚	
23.1.2	関連	取引金額			825,502	169,982	36,839	
23.2.1		建玉金額	2016/9/30	2016/9/30	18,817,090	1,198,781	277,928	
23.2.2		アセットクラス			金利	外国為替	株価指数	
23.2.3		商品タイプ			先物/オプション	Forex	CFD	
23.2.4		商品コード			YEA	-	-	
					0#JEY	0#TFXFX	TFX/CFD/INDEX	
23.3.1		執行機関(取引所)から提出された1日平均取引枚	2016/7/1	2016/9/30	8,254枚	167,324枚	23,164枚	
23.3.2		数						
		執行機関(取引所)から提出された想定元本額			825,502	169,982	36,839	