

FMI原則に基づく定量的な情報開示

(単位：百万円)

原則4 信用リスク				算出期間		TFXの清算対象商品		注記		
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引			
4.1	事前拋出型財務資源 (除く証拠金)	4.1.1	清算機関が拋出	清算参加者負担前に充当される額	2020/3/31	2020/3/31	800	1,800		
		4.1.2		清算参加者負担と同時に充当される額			0	0		
		4.1.3		清算参加者負担後に充当される額			0	0		
		4.1.4	清算参加者が拋出	清算預託金所要額			1,500	13,702		
		4.1.5		清算預託金預託額			6,992	26,980		
		4.1.6	その他	評価額			0	0		
	4.1.7	事後拋出型財務資源 (除く証拠金)	清算機関が拋出	破綻に充当される額	2020/3/31	2020/3/31	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			0			
	4.1.9		連鎖破綻に充当される額	上限なし			上限なし			
	4.1.10	その他	評価額	0			0			
4.2	KCCP	4.2.1	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(BCBS 282)	2020/3/31	2020/3/31	5	0			
4.3	事前拋出型財務資源 (除く証拠金)	4.3.1	現金	該当通貨の中央銀行に預託された現金	2020/3/31	2020/3/31	-	-	(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)			3,933	20,890		
		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		
		4.3.5	非現金	国債			1,088	7,370		
		4.3.6		外債			1,065	7,252		
		4.3.7		政府機関債			-	-		
		4.3.8		地方債			-	-		
		4.3.9		社債			-	-		
		4.3.10		株式			3,993	911		
		4.3.11		コモディティ(金)			2,794	638		
		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	時価			9,014	29,171		
		評価額	7,792	28,780						
4.4	信用エクスポージャー	4.4.1	想定損失額の算出要件	想定破綻先数	2019/4/1	2020/3/31	4社	3社	(4.4.1) 想定破綻先数は、想定損失残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3社、証拠金取引2社)としている。 (4.4.3~4.4.6) 4.4.1に記載の想定破綻先数の破綻を想定し、想定損失額を計算。 (4.4.7~4.4.10) 4.4.1の想定破綻先数について4.4.3~4.4.6に記載。	
		4.4.2		クローズアウト期間			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)	①想定損失残額(証拠金差引後)			最大値	2,283		15,487
				平均			993	7,288		
		4.4.4		②が事前拋出財務資源額を超過した日数			0日	2日		
		4.4.5		③が事前拋出財務資源額を超過した金額			-	284		
							-	256		
							-	-		
							-	-		
							-	-		
							-	-		
							-	-		
		4.4.6		実際に発生した損失残額(証拠金差引後)			最大値	8		1,486
			平均	8	1,366					
4.4.7	想定損失額(想定破綻先上位2社+関係会社)	④想定損失残額(証拠金差引後)	最大値	-	-					
			平均	-	-					
4.4.8		⑤が事前拋出財務資源額を超過した日数	-	-						
4.4.9		⑥が事前拋出財務資源額を超過した金額	-	-						
4.4.10		実際に発生した損失残額(証拠金差引後)	最大値	-	-					
			平均	-	-					

(単位：百万円)

原則5 担保				算出期間		TFXの清算対象商品		注記
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引	
5.1	当初証拠金の掛け目	5.1.1	代用有価証券に適用する掛け目	-	-	https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/a-09.pdf		(5.1.1、5.2.1) 2018年1Q開示分より、掛け目の算出に用いるサンプル期間は10年。
5.2	清算預託金の掛け目	5.2.1	代用有価証券に適用する掛け目	-	-	https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/b-18.pdf		
5.3	掛け目に係るテスト結果	5.3.1	カバー水準	2020/1/1	2020/3/31	100.00%	100.00%	
		5.3.2	担保の掛け目の想定保有期間			4日	4日	
		5.3.3	データ参照期間			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	

(単位：百万円)

原則6 証拠金				算出期間		TFXの清算対象商品			注記	
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	為替証拠金取引	株価指数証拠金取引		
6.1	証拠金所要額	6.1.1	証拠金所要額の総額	自己分(ネット)	2020/3/31	2020/3/31	62	31,566	1,638	(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。
				受託分(グロス)			-	57,886	8,223	
				受託分(ネット)			283	-	-	
				合計			345	89,452	9,861	

6.2	証拠金預託額	6.2.1 該当通貨の中央銀行に預託された現金		自己当初証拠金(時価)	2020/3/31	2020/3/31	-	-	-	(6.2.1~6.2.15) 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(評価額)	受託当初証拠金(時価)							
		6.2.1	該当通貨の中央銀行に預託された現金	自己当初証拠金(時価)	2020/3/31	2020/3/31	-	-	-	(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(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)			-	-	-	
		6.2.2	他の中央銀行に預託された現金	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)			-	-	-	
		6.2.3	商業銀行に預託された現金	元本保証型預金			5,112	148,804	15,339	
				自己当初証拠金(時価)			5,112	148,804	15,339	
				自己当初証拠金(評価額)			5,112	148,804	15,339	
				受託当初証拠金(時価)			1,873	281,505	64,223	
				受託当初証拠金(評価額)			1,873	281,505	64,223	
				当初証拠金合計(時価)			6,985	430,309	79,561	
				当初証拠金合計(評価額)			6,985	430,309	79,561	
		6.2.4		元本非保証型預金			-	-	-	
				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)			-	-	-	
		6.2.5	国債	自己当初証拠金(時価)			7,088	-	-	
				自己当初証拠金(評価額)			6,938	-	-	
				受託当初証拠金(時価)			1,533	-	-	
				受託当初証拠金(評価額)			1,491	-	-	
				当初証拠金合計(時価)			8,621	-	-	
				当初証拠金合計(評価額)			8,429	-	-	
		6.2.6	外債	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)			-	-	-	
		6.2.7	政府機関債	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)			-	-	-	
		6.2.8	地方債	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)			-	-	-	
		6.2.9	社債	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)			-	-	-	
		6.2.10	株式	自己当初証拠金(時価)			21,283	-	-	
				自己当初証拠金(評価額)			14,893	-	-	
				受託当初証拠金(時価)			365	-	-	
				受託当初証拠金(評価額)			255	-	-	
				当初証拠金合計(時価)			21,648	-	-	
				当初証拠金合計(評価額)			15,149	-	-	
		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)			33,483	148,804	15,339	
				自己当初証拠金(評価額)			26,943	148,804	15,339	
				受託当初証拠金(時価)			3,771	281,505	64,223	
				受託当初証拠金(評価額)			3,619	281,505	64,223	
				当初証拠金合計(時価)			37,253	430,309	79,561	
				当初証拠金合計(評価額)			30,562	430,309	79,561	
6.3	証拠金の基準レート	6.3.1	証拠金の基準レートに関する記載	金利先物等取引 為替証拠金取引(個人顧客) 為替証拠金取引(法人顧客・マーケットメイカー) 株価指数証拠金取引	-	-	https://www.tfx.co.jp/historical/futures/spparam.html	https://www.click365.jp/service/service01.html	https://www.click365.jp/service/service02.html	https://www.clickabu365.jp/service/service01.html

6.4	証拠金算出モデル	6.4.1	当初証拠金算出モデルのタイプ	金利先物等取引	-	-	SPAN方式 固定倍率（レバレッジ25倍）方式 ヒストリカルボラティリティ方式 レバレッジ25倍上限付きヒストリカルボラティリティ方式 レバレッジ上限付きヒストリカルボラティリティ方式 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の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。 (*1) 取引所為替証拠金取引の個人顧客による取引は、金商法令に定められた、レバレッジ倍率上限 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。 (*2) 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。 (*3) 取引所為替証拠金取引は法人顧客及びマーケットメイカーについて記載。	
				為替証拠金取引					個人顧客 法人顧客 マーケットメイカー
				株価指数証拠金取引					顧客 マーケットメイカー
		6.4.2	モデルタイプの変更日	顧客 マーケットメイカー	1996/4/8	2017/2/27			2018/2/19 2018/1/26
		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	個人顧客	99.00%	(*1)			99.00%
				法人顧客 マーケットメイカー	-	99.00%			-
		6.4.6	信頼水準の変更日		(*2)	(*2)			(*2)
		6.4.7	データ参照期間		6ヵ月	8週間または 104週間(*3)			24週間
		6.4.8	計算対象期間の変更日		(*2)	(*2)			(*2)
		6.4.9	ヒストリカルデータへの修正点等		-	-			-
		6.4.10	修正等に関する変更日		(*2)	(*2)			(*2)
		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		(*2)	(*2)			(*2)
6.4.13	当初証拠金レートに関するリンク先	金利先物等取引	https://www.tfx.co.jp/historical/futures/spparam.html						
		為替証拠金取引（個人顧客） 為替証拠金取引（法人顧客・マーケットメイカー） 株価指数証拠金取引	https://www.click365.jp/service/service01.html https://www.click365.jp/service/service02.html https://www.click365.jp/service/service01.html						
6.4.14	パラメーターレビューの頻度		1ヵ月毎	1週間毎	1週間毎				
6.4.15	パラメーターレビューの変更日		(*2)	(*2)	(*2)				

6.5	証拠金バックテスト	6.5.1.1	過去12ヵ月間に差金額が証拠金所要額を超過した回数	2019/4/1	2020/3/31	7回	7回	276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	バックテスト測定頻度			1回/日	1回/日	1回/日	
		6.5.1.3	バックテスト測定時刻			17:00:00	6:00:00	6:00:00	
		6.5.2	サンプル数			3,570	6,183	4,617	
		6.5.3	充足率			99.80%	99.89%	94.02%	
		6.5.4	証拠金超過額	最大値			44	8	
平均					9	2	143		

6.6	変動証拠金日次平均額	6.6.1	差金合計額	平均	2020/1/1	2020/3/31	51	3,863	1,317
6.7	変動証拠金日次最大額	6.7.1	差金合計額	最大値			264	32,846	10,546
6.8	追加証拠金日次最大額	6.8.1	追加証拠金必要額	最大値			10	414	184

(単位：百万円)

原則7 資金流動性リスク				算出期間		TFX の清算対象商品		注記	
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引		
7.1	資金流動性リスク	7.1.1	流動性資源のカバー対象	想定破綻先数	2020/3/31	2020/3/31	4社	3社	(7.1.1) 流動性必要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3社、証拠金取引2社） (7.1.4) 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) 決済銀行として指定した複数の商業銀行に設けており、契約に基づく手続きを行うことで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	適格流動性資源の規模	該当通貨を発行する中央銀行に預託する現金			0	0	
		7.1.3	ひ構成	他の中央銀行に預託する現金			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	181,866	
		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	
		7.1.6		流動性供給枠（有担保）			0	0	
		7.1.7		流動性供給枠（無担保）			29,000	0	
		7.1.8		カस्टディに預託された担保（流動性が高くストレステストにおいて事前の取極めにより換金可能なもの）			0	0	
		7.1.9		その他の流動性調達			0	0	
		7.1.10		中央銀行の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・方法の記載 https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/a1a08.pdf		
7.2	補助的な流動性資源	7.2.1	補助的な流動性資源の額	-	-	-	4,144		
7.3	資金流動性リスク	7.3.1	◎ストレステスト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）	当日決済額合計	2019/4/1	2020/3/31	2,656	26,990	(7.3.5~7.3.7) TFXは外貨決済を行っていない。
				当日決済額			2,656	26,990	
				日中支払額			-	-	
				日跨ぎ決済額			-	-	
		7.3.2	◎に対して流動性資源が不足した日数	0			0		
		7.3.3	◎に対して流動性資源が不足した際の金額	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）	当日決済額合計			192	4,210	
				当日決済額			192	4,210	
				日中支払額			-	-	
				日跨ぎ決済額			-	-	
7.3.5	◎ストレステスト時に必要な流動性の額（外貨・上位1社破綻を想定・四半期最大値）	-	-						
7.3.6	◎に対して流動性資源が不足した日数	-	-						
7.3.7	◎に対して流動性資源が不足した際の金額	-	-						

原則13 参加者破綻処理				算出期間		TFX の清算対象商品		注記	
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引		
13.1	清算参加者破綻時の情報開示	13.1.1	清算参加者破綻時の損失額と証拠金	2020/1/1	2020/3/31	-	-		
		13.1.2	損失補填をするために使用された清算預託金			-	-		
		13.1.3	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	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				算出期間		TFX の清算対象商品		注記
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引	
14.1	口座種別の割合	14.1.1	個別口座	2020/3/31	2020/3/31	0.00%	100.00%	
		14.1.2	オムニバス口座			100.00%	0.00%	
		14.1.3	LSOC口座			0.00%	0.00%	
		14.1.4	自己受託合同口座			0.00%	0.00%	

(単位：百万円)

原則15 ビジネスリスク				算出期間		TFX の清算対象商品		注記
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引	
15.1	ビジネスリスク	15.1.1	エクイティによる流動的な純資産の額	2019/4/1	2020/3/31	-	17,015	(*4)以下を控除した額を記載 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（2,835百万円） (*5)B/S上には取引参加者預り金のうち現金を含み、非現金は含まない。
		15.1.2	6ヵ月分の営業費用			-	1,544(*4)	
15.2	ビジネスリスク (財務情報)	15.2.1	営業収益	2019/4/1	2020/3/31	-	6,624	
		15.2.2	営業費用			-	7,294	
		15.2.3	営業損益			-	-669	
		15.2.4	総資産			-	561,096	
		15.2.5	負債合計			-	541,482	
		15.2.6	取引参加者預り金			-	(*5)	
		15.2.7	特記事項			-	-	

15.3	ビジネスリスク (収入の内訳)	15.3.1	営業収益に対する手数料収入の割合	2019/4/1	2020/3/31	90.69%	(15.3.1)TFXは取引手数料と清算手数料の区分を設けていない。
		15.3.2	営業収益に対する資産管理運用収入の割合			0.44%	

(単位：百万円)

原則16 保管・投資リスク				算出期間		TFXの清算対象商品		注記		
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引			
16.1	参加者から預託された現金の合計	16.1.1	証拠金	2020/3/31	2020/3/31	6,985	509,870			
		16.1.2	清算預託金			3,133	19,090			
16.2	参加者から預託された現金の内訳 (保持・預金・投資)	16.2.1	清算参加者から預託された現金合計	2020/3/31	2020/3/31	100.00%	100.00%	(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) (*6)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。 (16.2.18)投資は、担保の管理運用規則に基づき行われている。		
		16.2.2	た現金担保を現金のまま	中央銀行			0.00%		0.00%	
		16.2.3	保持する割合	他の中央銀行			0.00%		0.00%	
		16.2.4		商業銀行(元本保証型預金)			100.00%		100.00%	
		16.2.5		商業銀行(元本非保証型預金)			0.00%		0.00%	
		16.2.6		M M F			0.00%		0.00%	
		16.2.7		その他			0.00%		0.00%	
		16.2.8		通貨別内訳(日本円)			100.00%		100.00%	
		16.2.9		現金比率			100.00%		100.00%	
		16.2.10		平均残存期間			(*6)		0.37年	
		16.2.11	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	日本国債				-	0.00%
		16.2.12		16.2.12	外国国債				-	-
		16.2.13		16.2.13	政府機関債				-	-
		16.2.14		16.2.14	地方債				-	-
		16.2.15		16.2.15	その他債券				-	-
		16.2.16		16.2.16	通貨別内訳(日本円)				-	0.00%
		16.2.17		16.2.17	平均残存期間				-	-
16.2.18		16.2.18	投資ポートフォリオに係るリスク推定値			-	-			
16.2.19		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		16.2.20	前四半期における限度額を超過した日数			-	-			
16.3	資産再担保 (非現金)	16.3.1	現金で預託された担保のうち有価証券で保有されている割合	2020/3/31	2020/3/31	0.00%	0.00%	(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	非現金再担保総額			-	-			
		16.3.3	清算預託金			-	-			
		16.3.4	再投資されている非現金担保の満期期間			-	-			

原則17 オペレーショナルリスク				算出期間		TFXの清算対象商品		注記
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引	
17.1	システムの安定稼働	17.1.1	安定稼働目標	-	-	100.00%	100.00%	
17.2		17.2.1	安定稼働実績	2019/4/1	2020/3/31	100.00%	100.00%	
17.3	システム障害	17.3.1	発生頻度・継続時間			0回	0回	
17.4		17.4.1	復旧目標時間			2時間	2時間	

原則18 アクセス・参加要件				算出期間		TFXの清算対象商品		注記			
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引				
18.1	清算参加者数	18.1.1.1	参加形態	総合清算参加者(自社及び他社清算)	2020/3/31	2020/3/31	29社	0社			
		18.1.1.2		直接清算参加者(自社清算のみ)			1社	27社			
		18.1.1.3		その他カテゴリの清算参加者			0社	0社			
		18.1.2.1	参加者の業態	中央銀行			0社	0社			
		18.1.2.2		清算機関			0社	0社			
		18.1.2.3		銀行			12社	4社			
		18.1.2.4		その他カテゴリ業種			18社	23社			
		18.1.3.1	国内・海外	国内			29社	25社			
		18.1.3.2		海外			1社	2社			
		18.2	建玉の上位集中度	18.2.1	清算参加者25社未満：上位5社の建玉シェア	最大値	2020/1/1	2020/3/31		-	-
平均							-	-			
18.2.2	清算参加者25社以上：上位5社の建玉シェア			最大値			77.07%	76.47%			
				平均			67.74%	70.67%			
18.2.3	清算参加者25社以上：上位10社の建玉シェア			最大値			96.88%	87.49%			
				平均			94.08%	84.51%			
18.3	証拠金の上位集中度	18.3.1	清算参加者25社未満：上位5社の証拠金シェア	最大値	2020/1/1	2020/3/31	-	-			
				平均			-	-			
		18.3.2	清算参加者25社以上：上位5社の証拠金シェア	最大値			73.73%	77.58%			
				平均			72.71%	77.06%			
		18.3.3	清算参加者25社以上：上位10社の証拠金シェア	最大値			91.50%	89.83%			
				平均			90.70%	89.40%			
		18.4	清算預託金の上位集中度	18.4.1	清算参加者25社未満：上位5社の清算預託金シェア	2020/3/31	2020/3/31	-		-	
				18.4.2	清算参加者25社以上：上位5社の清算預託金シェア			16.67%		74.12%	
				18.4.3	清算参加者25社以上：上位10社の清算預託金シェア			33.33%		90.34%	

原則19 階層別参加形態				算出期間		TFXの清算対象商品		注記	
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	証拠金取引		
19.1	階層別参加形態 顧客取引の集中度合い	19.1.1	顧客の数(口座数)	2020/1/1	2020/3/31	-	1,296,648口座		
		19.1.2	受託取引を行う清算参加者の数			30社	20社		
		19.1.3.1	清算参加者10社以上：清算参加者上位5社の顧客の取引シェア	最大値			100.00%		81.67%
				平均			95.42%		76.31%
		19.1.4.1	清算参加者25社以上：清算参加者上位10社の顧客の取引シェア	最大値			100.00%		93.62%
				平均			100.00%		91.99%

(単位：百万円)

原則23 市場データ等の開示				算出期間		TFXの清算対象商品			注記
項目	開示項目	Ref.No.	開示内容	算出開始日	算出終了日	金利先物等取引	為替証拠金取引	株価指数	
23.1	日々の取引量の平均	23.1.1	取引枚数	2020/1/1	2020/3/31	2,169枚	232,054枚	103,312枚	
		23.1.2	取引金額			216,854	202,733	217,243	
23.2	未決済取引	23.2.1	建玉金額	2020/3/31	2020/3/31	3,748,954	1,279,905	454,167	
		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	ブルームバーグ社 ロイター社			YEA 0#JEY	JNUSCFD 0#TFXFX	
23.3	取引執行機関の情報	23.3.1	執行機関(取引所)から提出された1日平均取引枚数	2020/1/1	2020/3/31	2,169枚	232,054枚	103,312枚	
		23.3.2	執行機関(取引所)から提出された想定元本額			216,854	202,733	217,243	