

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 事前拠出型財務資源 (除く証拠金)	4.1.1	清算機関が拠出	清算参加者負担前に充当される額	2025/9/30	2025/9/30	200	2,000	(4.1.1) 事前拠出型財務資源(除く証拠金)の清算対象商品は、金利先物等取引と証拠金取引です。	
	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		清算参加者が拠出			1,300	3,357		
	4.1.5		清算預託金所要額			4,654	19,006		
	4.1.6		清算預託金預託額 評価額			0	0		
	4.1.7	清算機関が拠出	清算参加者負担前に充当される額	2025/9/30	2025/9/30	0	0		
	4.1.8		清算参加者が拠出			0	0		
	4.1.9		清算参加者負担後に充当される額			上限なし	上限なし		
	4.1.10		その他			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)			2025/9/30	2025/9/30	10	419	
4.3 事前拠出型財務資源 (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	2025/9/30	2025/9/30	-	-	(4.3.1) 事前拠出型財務資源(除く証拠金)の清算対象商品は、金利先物等取引と証拠金取引です。	
	4.3.2		評価額			-	-		
	4.3.3		他の中銀に預託された現金			-	-		
	4.3.4		評価額			2,783	15,334		
	4.3.5		商業銀行に預託された現金(元本保証型預金)			2,783	15,334		
	4.3.6		評価額			0	0		
	4.3.7	商業銀行に預託された現金(元本非保証型預金)	時価	2025/9/30	2025/9/30	0	0		
	4.3.8		評価額			905	5,213		
	4.3.9		時価			882	5,106		
	4.3.10		評価額			-	-		
	4.3.11		政府機関債			-	-		
	4.3.12		評価額			-	-		
	4.3.13	地方債	時価			-	-		
	4.3.14		評価額			-	-		
	4.3.15		時価			1,700	810		
			評価額			1,189	567		
			時価			-	-		
			評価額			-	-		
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	2024/10/1	2025/9/30	4社	3社	(4.4.1) 想定破綻先数は、想定損失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。	
	4.4.2		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)	④想定損失残額 (証拠金差引後)	最大値 平均		45	5,188		
	4.4.4		④が事前拠出財務資源額を超過した日数			15	2,746		
	4.4.5		④が事前拠出財務資源額を超過した金額			0日	0日		
	4.4.6	想定損失額(想定破綻先上位2社+関係会社)	実際に発生した損失残額 (証拠金差引後)	最大値 平均		-	-		
	4.4.7		最大値 平均			12	428		
	4.4.8		⑥が事前拠出財務資源額を超過した日数			7	428		
	4.4.9		⑥が事前拠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		-	-		
			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		-	-	<a href="https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/a-09.pdf">https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/a-09.pdf</a>		(5.1.1) 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		-	-	<a href="https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/h-03.pdf">https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/h-03.pdf</a>				
5.3 掛け目に係るテスト結果	5.3.1	カバー水準		2025/7/1	2025/9/30	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	想定保有期間ににおいて掛け目を超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		
6.1 証拠金所要額	6.1.1	証拠金所要額の総額		2025/9/30	2025/9/30	29	22,493	4,096	(6.1.1) 取引所為替証拠金取引及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)			-	53,840	15,144	
			受託分(グロス)			24	-	-	
			受託分(ネット)			54	76,333	19,240	

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)	2025/9/30	2025/9/30	-	-	-	(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標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。  (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)	2025/9/30	2025/9/30	-	-	-	
				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	自己当初証拠金(時価)	2025/9/30	2025/9/30	5,112	187,969	9,681	
				自己当初証拠金(評価額)			5,112	187,969	9,681	
		6.2.4	元本保証型預金	受託当初証拠金(時価)	2025/9/30	2025/9/30	1,349	244,940	91,290	
				受託当初証拠金(評価額)			1,349	244,940	91,290	
				当初証拠金合計(時価)			6,461	432,909	100,971	
				当初証拠金合計(評価額)			6,461	432,909	100,971	
				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)			-	-	-	
				自己当初証拠金(時価)			6,849	-	-	
				自己当初証拠金(評価額)			6,711	-	-	
				受託当初証拠金(時価)			601	-	-	
				受託当初証拠金(評価額)			584	-	-	
				当初証拠金合計(時価)			7,450	-	-	
				当初証拠金合計(評価額)			7,295	-	-	
		6.2.6	外債	自己当初証拠金(時価)	2025/9/30	2025/9/30	-	-	-	
				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)	2025/9/30	2025/9/30	-	-	-	
				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)	2025/9/30	2025/9/30	-	-	-	
				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)	2025/9/30	2025/9/30	-	-	-	
				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)	2025/9/30	2025/9/30	9,774	-	-	
				自己当初証拠金(評価額)			6,839	-	-	
				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)			9,774	-	-	
				当初証拠金合計(評価額)			6,839	-	-	
		6.2.11	コモディティ(金)	自己当初証拠金(時価)	2025/9/30	2025/9/30	-	-	-	
				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)	2025/9/30	2025/9/30	-	-	-	
				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)						

(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	2025/9/30	2025/9/30	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）	
		7.1.2	適格流動性資源の規模及び構成 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	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	120,547	(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）	
		7.1.5	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	(7.1.7) 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取ることで資金を当日利用することが可能。	
		7.1.8	カストディに預託された担保（流動性が高くストレス時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) 日本銀行に決済目的で当座預金口座を開設。	
		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			<a href="https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/a-09.pdf">https://www.tfx.co.jp/rules/pdf/a-09.pdf</a>			
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	-	-	3,839			
7.3	資金流動性リスク	7.3.1	◎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）	当日決済額合計	2024/10/1	2025/9/30	73	18,774	(7.3.1)想定損失残額(4.4.3)が発生した場合に表示。
				当日決済額			73	18,774	
				日中支払額			-	-	
				日跨ぎ決済額			-	-	(7.3.4)証拠金取引は、当日に出金可能な証拠金余剰1,621億円のうち343億円が引き出されたもの。（流出日2025年1月29日の流動性必要額に対する充足率は1434%）
		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				-	-	
		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			65	34,311	(7.3.5~7.3.7) TFXは外貨決済を行っていない。
				当日決済額			65	34,311	
				日中支払額			-	-	
				日跨ぎ決済額			-	-	
		7.3.5	◎ストレス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				0	0	

### 原則 1.3 參加者破綻処理

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 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		2025/7/1	2025/9/30	-	-	-
	13.1.2	損失補填をするために使用された清算預託金				-	-	-
	13.1.3.1	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 1 4 分別管理

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	口座種別の割合	14.1.1	個別口座	2025/9/30	2025/9/30	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	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	2024/4/1	2025/3/31	18,768	(*4)以下を控除した額を記載 ・減価償却費	(*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			1,639(*4)		
15	ビジネスリスク (財務情報)	15.2.1	営業収益	2024/4/1	2025/3/31	4,474		(*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。
		15.2.2	営業費用			3,637		
		15.2.3	営業損益			837		
		15.2.4	総資産			590,332		
		15.2.5	負債合計			568,364		
		15.2.6	取引参加者預り金			566,692		
		15.2.7	特記事項			-		
15	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	2024/4/1	2025/3/31	76.82%	(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。	(*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。
		15.3.2	営業収益に対する資産管理運用収入の割合			8.83%		

(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	参加者から預託された現金の合計	16.1.1	証拠金	2025/9/30	2025/9/30	6,461	533,880	(*6)預託されている現金担保は、全て商業銀行の普通預金（決済性）で管理している。
		16.1.2	清算預託金			2,583	13,334	
16	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現金合計	2025/9/30	2025/9/30	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。（元本割り戻のない普通預金、定期預金等） (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			0.00%	0.00%	
		16.2.3	保持する割合			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	MMF			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)	0.10年	
		16.2.11	日本国債			-	0.00%	
		16.2.12	外国国債			-	-	
		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	通貨別内訳（日本円）			-	0.00%	
		16.2.17	平均残存期間			-	-	
		16.2.18	投資ポートフォリオによるリスク推定値			-	-	
		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			-	-	
		16.2.21	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			0.00%	0.00%	
16	資産再担保 (非現金)	16.3.1	非現金再担保総額	2025/9/30	2025/9/30	当初証拠金	-	(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	清算預託金			-	-	
		16.3.3	再投資されている非現金			当初証拠金	-	
		16.3.4	担保の満期期間			清算預託金	-	

原則17 オペレーションリスク			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	システムの安定稼働	17.1.1	安定稼働目標	-	-	100.00%	100.00%	(*6) 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。
		17.2.1	安定稼働実績			100.00%	100.00%	
17	システム障害	17.3.1	発生頻度・継続時間	2024/10/1	2025/9/30	0回	0回	(*6) 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。
		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	清算参加者数	18.1.1.1	参加形態	2025/9/30	2025/9/30	26社	0社	(*7) TFXは清算手数料と清算手数料の区分を設けていない。
		18.1.1.2	直接清算参加者（自社清算のみ）			1社	29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	2025/7/1	2025/9/30	0社	0社	
		18.1.2.2	中央銀行			0社	0社	
		18.1.2.3	清算機関			12社	3社	
		18.1.2.4	銀行			15社	26社	
		18.1.3.1	その他カテゴリ業種			26社	27社	
		18.1.3.2	国内			1社	2社	
18	建玉の上位集中度	18.2.1	海外	2025/7/1	2025/9/30	-	-	(*8) TFXは清算手数料と清算手数料の区分を設けていない。
		18.2.2	最大値			-	-	
		18.2.3	平均			100.		

原則 2.3 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	
23	日々の取引量の平均	23.1.1	取引枚数	2025/7/1	2025/9/30	5,723枚	60,990枚	149,793枚
		23.1.2	取引金額			142,075	65,267	234,043
23	未決済取引	23.2.1	建玉金額	2025/9/30	2025/9/30	117,921	1,218,934	414,610
		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			YPOA Comdty	JNUSCFD	TFXJNKY
23	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	2025/7/1	2025/9/30	0#J03:	0#TFXFX	TFX/CFD/INDEX
		23.3.2	執行機関（取引所）から提出された想定元本額			5,723枚	60,990枚	149,793枚
						142,075	65,267	234,043