

## 必要証拠金一覧表 (MATRIX TRADER 法人のお客様用)

通貨ペア	1Lot あたりの 通貨数量	1 回あたりの 最大注文可能数量※1	通貨ペア別の 保有上限数量	1Lot あたりの 必要証拠金※2	呼び値の 最小変動単位	指値・逆指値指定 不可の範囲※3
------	-------------------	-----------------------	------------------	----------------------	----------------	---------------------

### 【A】

AUD/CHF	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050
AUD/JPY	1,000 通貨	3,000Lot	15,000Lot	①	0.001	0.050
AUD/NZD	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050
AUD/USD	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050

### 【C】

CAD/JPY	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.001	0.050
CHF/JPY	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.001	0.050

### 【E】

EUR/AUD	1,000 通貨	1,000Lot	20,000Lot	①	0.00001	0.00050
EUR/CHF	1,000 通貨	1,000Lot	20,000Lot	①	0.00001	0.00050
EUR/GBP	1,000 通貨	1,000Lot	30,000Lot	①	0.00001	0.00050
EUR/JPY	1,000 通貨	1,000Lot	30,000Lot	①	0.001	0.050
EUR/USD	1,000 通貨	1,000Lot	30,000Lot	①	0.00001	0.00050

### 【G】

GBP/AUD	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050
GBP/CHF	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050
GBP/JPY	1,000 通貨	1,000Lot	30,000Lot	①	0.001	0.050
GBP/USD	1,000 通貨	2,000Lot	30,000Lot	①	0.00001	0.00050

### 【M】

MXN/JPY	10,000 通貨	100Lot	5,000Lot	①	0.001	0.005
---------	-----------	--------	----------	---	-------	-------

### 【N】

NOK/JPY	10,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.001	0.005
NZD/CHF	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050
NZD/JPY	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.001	0.050
NZD/USD	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050

### 【S】

SEK/JPY	10,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.001	0.005
---------	-----------	----------	-----------	---	-------	-------

### 【T】

TRY/JPY	1,000 通貨	500Lot	10,000Lot	①	0.001	0.050
---------	----------	--------	-----------	---	-------	-------

### 【U】

USD/CAD	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050
USD/CHF	1,000 通貨	1,000Lot	15,000Lot	①	0.00001	0.00050
USD/JPY	1,000 通貨	1,000Lot	30,000Lot	①	0.001	0.050

### 【Z】

ZAR/JPY	1,000 通貨	5,000Lot	50,000Lot	①	0.001	0.005
---------	----------	----------	-----------	---	-------	-------

通貨ペア	1Lot あたりの 通貨数量	1 回あたりの 最大注文可能数量※1	通貨ペア別の 保有上限数量	1Lot あたりの 必要証拠金※2	呼び値の 最小変動単位	指値・逆指値指定 不可の範囲※3
------	-------------------	-----------------------	------------------	----------------------	----------------	---------------------

1 口座あたりのポジション上限数量は、通貨ペア、1 回の取引数量にかかわらず、1,300 ポジションとなります。

※1 最大注文可能数量は、相場の状況により変動する場合がありますので、ログイン後の取引条件一覧をご確認ください。最大注文可能数量以上の注文を発注される場合は、分割して行ってください。

※2 ①=レート×1Lot あたりの通貨数量×為替リスク(10 円未満切り上げ)

※3の項目の数値は、流動性等により記載されているものより小さくなる場合があります。

以下、※2の算出方法の具体例です。

<一般社団法人金融先物取引業協会における為替リスク想定比率の算出方法>

I 価格データの生成	(1) 為替リスク想定比率の算出に用いる価格データには、NEX Data Services Ltd (以下、「NEX Data」といいます。)の FX Market Reference Rate を用いる。FX Market Reference Rate の生成は NEX Data により次の手順で行われる。
	① 主要な通貨ペアについては、当該通貨ペアごとに EBS Market プラットフォームから各営業日における東京時間 15 時の前後 2 分 30 秒の取引データを取得し、出来高加重平均価格 (Volume Weighted Average Price。以下、「VWAP」といいます。)を算出する。
	② VWAP 算出に必要なデータが十分にとれない通貨ペアについては、NEX Data が事前の取決めにより段階的な代替手段を以って価格データを生成する。
	なお、FX Market Reference Rate が利用できないような事態が発生した場合には、金融先物取引業協会の緊急時対応計画及び BCP に従い、価格データを用意する。
II 直近 26 週を対象とした数値の計算	(2) 基準日 (毎週金曜日。以下同じ。)の属する週から起算して過去 26 週の各営業日において、当日価格データ ÷ 前日価格データの結果の自然対数を求める。
	(3) (2)の標準偏差を求め、片側 99%をカバーするため、それに 2.33 を掛ける
III 直近 130 週を対象とした数値の計算	(4) 基準日の属する週から起算して過去 130 週の各営業日において、当日価格データ ÷ 前日価格データの結果の自然対数を求める。
	(5) (4)の標準偏差を求め、片側 99%をカバーするため、それに 2.33 を掛ける。
IV 為替リスクの決定	(6) (3)と(5)を比べ、大きい方を為替リスク想定比率とする。

<(例)USD/JPY の為替リスク>

【計算例】基準日を 2017/02/17(金)※とし、USD/JPY について計算する。

(1) USD/JPY について必要な価格データを準備する。

<直近 26 週を対象とした数値の計算>

(2)  $113.39(02/17 \text{ の価格データ}) \div 113.86(02/16 \text{ の価格データ}) = 0.995872124 \dots \textcircled{1}$

①の自然対数は、 $\text{LN}(0.995872124) = -0.00413642 \dots \textcircled{2}$

過去 26 週 (2016/08/22 から 2017/02/17) の各営業日について①②と同様に

当日価格データ ÷ 前日価格データの結果の自然対数を求める。…③

(3) ③の標準偏差を求める。0.008121682 …④

④ × 2.33 = 0.018923519 …⑤

<直近 130 週を対象とした数値の計算>

(4) 過去 130 週 (2014/08/25 から 2017/02/17) の各営業日について①②と同様に

当日価格データ ÷ 前日価格データの結果の自然対数を求める。・・・⑥

(5)⑥の標準偏差を求める。0.006574288 ...⑦

⑦ × 2.33 = 0.015318091 ...⑧

(6)⑤と⑧の数値を比較して大きい方を為替リスクとして採用(レバレッジが低い方を採用)する。

この場合は、⑤の 0.018923519 となる。

(7)金融先物取引業協会が公表する値は、⑤ × 100 = 1.8923519 の小数点第 3 位を切上げたものになるため、1.90%となる。

レバレッジは、その 1.90 の逆数 × 100 = 52.63157894 の小数点第 3 位以下を切り捨てた 52.63 倍となる。

上述の計算を各通貨ペアに対して行う。

項目	通貨ペア	為替リスク	1Lot あたりの必要証拠金の計算式
例 1	USDJPY	1.90%	①=レート×1Lot あたりの通貨数量×為替リスク(10 円未満切り上げ)
例 2	GBPJPY	2.13%	
例 3	GBPUSD	1.49%	
例 4	ZAR/JPY	2.84%	

<計算式①>

例 1 USD/JPY

月	火	水	木	金	土	日
—	—	—	—	終値 116.887	—	—
終値 116.887	終値 117.742(★)	終値 117.239	終値 115.34(●)	—	—	—
必要証拠金の公表	—	—	—	—	—	—
必要証拠金の適用期間	← 適用期間 →				—	—

必要証拠金=レート×1Lot あたりの通貨数量×為替リスク(10 円未満切り上げ)

レート(★)	1Lot あたりの通貨数量	為替リスク	算出結果	必要証拠金(10 円未満切り上げ)
117.742	1,000	1.90%	2237.098	2,240 円

<計算式①>

例 2 GBP/JPY

月	火	水	木	金	土	日
—	—	—	—	終値 144.055	—	—
終値 144.055	終値 144.1	終値 144.466(★)	終値 143.222	—	—	—
必要証拠金の公表	—	—	—	—	—	—
必要証拠金の適用期間	← 適用期間 →				—	—

必要証拠金=レート×1Lot あたりの通貨数量×為替リスク(10 円未満切り上げ)

レート(★)	1Lot あたりの通貨数量	為替リスク	算出結果	必要証拠金(10 円未満切り上げ)
144.466	1,000	2.13%	3077.1258	3,080 円

<計算式①>

例 3 GBPUSD

月	火	水	木	金	土	日
—	—	—	—	終値 1.23232	—	—

終値	1.23232	終値	1.22382	終値	1.23223	終値	1.24159(★)	—	—	—
必要証拠金の公表	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
必要証拠金の適用期間	←						→	適用期間		

必要証拠金=レート×1Lotあたりの通貨数量×為替リスク(10円未満切り上げ)

レート(★)	1Lotあたりの通貨数量	為替リスク	円換算レート USD/JPY(●)	算出結果
1.24159	1,000	1.49%	115.34	2133.75436

必要証拠金 (10円未満切り上げ)
2,140円

<計算式①>

例4 ZAR/JPY

月	火	水	木	金	土	日		
—	—	—	—	終値 8.508	—	—		
終値 8.508(●)	終値 8.509	終値 8.608(★)	終値 8.496	—	—	—		
必要証拠金の公表	—	—	—	—	—	—		
必要証拠金の適用期間	←						→	適用期間

必要証拠金=レート×1Lotあたりの通貨数量×為替リスク(10円未満切り上げ)

レート(★)	1Lotあたりの通貨数量	為替リスク	算出結果	必要証拠金 (10円未満切り上げ)
8.608	1,000	2.84%	244.4672	250円

2021年5月10日現在