

【店頭FXの自動ロスカット・追証・レバレッジ規制ルールのおまとめ】

| | (1) 自動ロスカットルール | (2) 証拠金管理ルール | | (3) レバレッジ規制 |
|--------------------------------------|---|--|--|--|
| | ① 自動ロスカット | 追証 ② 総額 | ③ 証拠金現金不足 | ④ 法定預託金不足 |
| 発生条件 | 建玉に一定の損失が発生 | FX証拠金 < 必要証拠金 | FX証拠金現金 < 0 | FX証拠金(時価) < 法定預託金 |
| 発生要因 | 評価損拡大 (アクション後は実現損) | 代用評価の下落 | 決済損発生 | 評価(決済)損拡大 または代用評価の下落により (受入証拠金+評価(決済)損益-諸経費) ÷ 法定預託金 < 100%となった場合 |
| 対象建玉 | 個別 | 全体 | - | 全体 |
| アクション | 逆指値注文約定 | 全建玉決済 全未約定注文取消し | 証券口座(預り金)から 強制振替 | 全建玉決済 全未約定注文取消し |
| 判定頻度 | 常時 | 1回/当社営業日 | 1回/当社営業日 (FX取引画面では即通知) | 1回/当社営業日 |
| 解消アクション | | | | |
| リアルタイム | - | 現金もしくは 代用差入れ | 判定後はなし | ・現金もしくは代用差入れ ・未約定の新規注文取消 ・保有ポジションの全部または一部を決済 |
| (判定翌営業日朝) | - | 決済、注文取消し、 代用評価上昇 | - | - |
| (判定翌営業日15時) | - | 決済、注文取消し | - | - |
| 判定からアクションまでの時間 | なし | 通知した翌営業日15時 | - | 通知した翌日午前0時 (日本の祝日含む) |
| 特記事項 | ・複数建玉保有→自動ロス カットレベルに達した建玉 のみ執行 ・証拠金の過不足に関係 なく執行 | - | アクションの結果、預り金 が不足になると、15時時点で 立替金発生 | ・法定預託金は 新規建て時の為替レート ×取引数量×4% ・不足金確定後は、評価損 益の改善や代用評価の上昇 で解消しない |
| 上記①～④はそれぞれ独立したルールであり、同時に発生することもあります。 | | | | |
| イメージ図 | <p>建玉評価損益 100%</p> <p>約20% 逆指値)</p> <p>A B</p> <p>複数建玉AB保有ケース → Bのみ約8%の損失レベル で逆指値注文約定</p> | <p>必要保証金</p> <p>代用現金</p> <p>現金</p> <p>現金 or 代用 で差入必要</p> | <p>代用現金</p> <p>現金</p> <p>実現損</p> <p>現金で 差入必要</p> | <p>法定預託金</p> <p>代用+現金</p> <p>評価損</p> <p>法定預託金</p> <p>代用+現金</p> <p>現金 or 代用で 差入必要</p> |