

自己資本規制比率の状況(単体)

【平成29年9月末 現在】

投資ファンド『一銭』
ISSEN Investors' Fund Inc.



【単位:千円】

項 目	指 標
固定化されていない 自己資本の額(A)※	15,793
リスク相当額合計(B)	924
市 場 リ ス ク 相 当 額	424
取 引 先 リ ス ク 相 当 額	0
基 礎 的 リ ス ク 相 当 額	500
自己資本規制比率 (A/B×100)	1709.2%

この書面は、金融商品取引法第46条の6 第3項に基づき、全ての営業所に備え置き、公衆の縦覧に供するために作成したものです。

※固定化されていない自己資本の額(A)は、ST部門の現物買付余力のことを指します。

リスク相当額の算出方法

■市場リスク相当額

トヨタ自動車AA型種類株式を除く全ての保有株式について、為替・株価の変動に伴い発生する可能性がある損失を合理的に見積り、市場リスク相当額を算出しております。具体的には各証券会社が設定している代用掛目を参考に変動率を算出しております。

【例】代用掛目80%の銘柄 → 20%は変動(損失が発生)する可能性がある想定
代用掛目50%の銘柄 → 50%は変動
代用掛目 0%の銘柄 → 全額が変動

■取引先リスク相当額

当ファンドの主要取引先は証券会社・金融機関であります。
なお、株式については投資者保護制度、預金については預金保護(ペイオフ)制度の適用範囲内でそれぞれポジション管理・取引を行っておりますので、取引先に万が一事故があった場合においても発生する損失は極めて限定的であると考えております。そのため、現時点では取引先リスク相当額は算出しておりません。

■基礎的リスク相当額

取引担当者の判断ミス・発注ミス等により発生する可能性のある損失を基礎的リスク相当額として算出しております。
具体的には年間取引金額(国内株式・社債等/現物)の0.1%相当を想定しております。

以上