

# 統計データ (国債店頭取引)

2016年6月



株式会社 日本証券クリアリング機構

## 【目次】

- 債務引受け・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 1
- 国債・資金決済・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 1
- ネットティング効果・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 3

## 【例言】

- 本統計データは、当社が行う国債店頭取引清算業務（2013年9月までは日本国債清算機関が行う清算業務）を対象としております。
- 掲載数値の単位未満は切捨て、平均値は四捨五入としております。（内訳とその合計が合致しない場合があります。）
  - 本統計データに係る表記方法は、次のとおりです。

|     |        |
|-----|--------|
| 「r」 | 訂正值    |
| 「…」 | 不詳・その他 |

※rについては、次回公表時から削除します。
- 債務引受けについて
  - 債務引受けは、引受日を基準に、売り手・買い手（貸し手・借り手）双方からの額面、金額、件数を合計しております。現金担保付債券貸借取引及び現先取引は、スタート取引及びエンド取引について額面、金額の合計となっております。（件数はスタート取引とエンド取引合わせて一件として集計しております。）また、エンドのみ引受けの場合は、エンド取引のみ対象としております。なお、現先取引のサブスティテューションに係る当初現先取引の終了を目的とした取引は集計対象外としております。
  - 取引種別債務引受高は、債務引受高（額面）について、売買、現金担保付債券貸借取引、現先取引別の内訳となります。通常債務引受けはスタート取引とエンド取引両方について債務引受けしたものととなります。エンドのみ債務引受けはエンド取引のみについて債務引受けしたものととなります。
- 国債・資金決済について
  - DVP決済状況は、債務引受けに係る決済について 決済日をベースに集計しております。また、当社の国債受取り及び引渡しの両方について、額面、金額、件数を合計しております。
  - FOS決済状況は、決済日をベースに集計しております。当社の受取り及び支払の両方についての金額の合計です。  
（FOS決済：変動証拠金等の資金のみ決済。）
  - フェイル発生状況については、当社が受けたフェイルの額面及び件数を集計しております。  
【参考】における「日本銀行決済高」と「日本銀行決済件数」は、日本銀行調べです。
- ネットティング効果について
  - 債務引受けは、決済日を基準に、売り手・買い手（貸し手・借り手）双方からの額面及び金額を合計しております。
  - 現金担保付債券貸借取引及び現先取引は、スタート日が月内であればスタート取引を対象に、エンド日が月内であればエンド取引を対象にして額面及び金額を集計しております。
  - エンドのみ引受けの場合は、エンド日が月内であれば対象として集計しております。
  - DVP決済高（額面）及びDVP決済金額は、当初の決済日を基準に集計しております。  
（実際に決済が完了した金額の集計ではなく、決済予定ベースでの集計です。）当社の国債受取り及び引渡しの両方について額面及び金額を合計しております。

## 【注意事項】

- 原則として、本統計データは、翌月の第3営業日目頃に掲載します。
- 当社は、出所を明示する場合にのみ本統計データの転用・引用を認めます。商用目的で転載等を行う場合、予め当社までご連絡ください。
- 本統計データの情報の正確性については、万全を期していますが、当社は当該情報の利用者に対し、一切の責任を負いません。

## 【お問合せ先】

（株）日本証券クリアリング機構 国債店頭取引清算グループ  
電話：03-5645-3810  
e-mail：jgb-plan@jscc.co.jp

## I 債務引受け

### 1. 債務引受け(額面、金額、件数)

(単位:百万円、件)

| 年月     | 営業日数 | 債務引受高(額面)      |             | 債務引受金額         |             | 件数        |        |
|--------|------|----------------|-------------|----------------|-------------|-----------|--------|
|        |      |                | 一日平均        |                | 一日平均        |           | 一日平均   |
| 2014   | 244  | 23,717,799,731 | 97,204,097  | 24,432,474,098 | 100,133,091 | 2,316,802 | 9,495  |
| 2015   | 244  | 27,275,080,220 | 111,783,116 | 28,373,307,529 | 116,284,047 | 2,719,040 | 11,144 |
| 2016   | 122  | 13,376,038,593 | 109,639,661 | 14,246,063,864 | 116,771,015 | 1,392,846 | 11,417 |
| 15. 06 | 22   | 2,557,320,419  | 116,241,837 | 2,642,121,372  | 120,096,426 | 259,420   | 11,792 |
| 15. 07 | 22   | 2,507,235,496  | 113,965,250 | 2,595,509,345  | 117,977,698 | 234,336   | 10,652 |
| 15. 08 | 21   | 2,281,493,322  | 108,642,539 | 2,366,652,337  | 112,697,730 | 212,746   | 10,131 |
| 15. 09 | 19   | 2,049,791,872  | 107,883,783 | 2,134,647,741  | 112,349,881 | 208,610   | 10,979 |
| 15. 10 | 21   | 2,227,424,553  | 106,067,836 | 2,327,570,562  | 110,836,693 | 217,266   | 10,346 |
| 15. 11 | 19   | 1,966,682,081  | 103,509,583 | 2,055,320,851  | 108,174,782 | 189,998   | 10,000 |
| 15. 12 | 21   | 2,244,140,173  | 106,863,818 | 2,347,965,841  | 111,807,897 | 222,396   | 10,590 |
| 16. 01 | 19   | 2,299,516,243  | 121,027,171 | 2,403,714,742  | 126,511,302 | 217,102   | 11,426 |
| 16. 02 | 20   | 2,218,548,872  | 110,927,444 | 2,361,541,911  | 118,077,096 | 255,006   | 12,750 |
| 16. 03 | 22   | 2,053,423,515  | 93,337,433  | 2,213,591,889  | 100,617,813 | 252,816   | 11,492 |
| 16. 04 | 20   | 2,101,216,364  | 105,060,818 | 2,242,401,155  | 112,120,058 | 228,264   | 11,413 |
| 16. 05 | 19   | 2,136,377,459  | 112,440,919 | 2,281,265,435  | 120,066,602 | 195,346   | 10,281 |
| 16. 06 | 22   | 2,566,956,139  | 116,679,825 | 2,743,548,729  | 124,706,760 | 244,312   | 11,105 |

### 2. 取引種類別債務引受高(額面)

(単位:百万円)

| 年月     | 売買            | 現金担保付債券貸借取引    |                       |                | 現先取引          |                       |                |
|--------|---------------|----------------|-----------------------|----------------|---------------|-----------------------|----------------|
|        |               | 合計             | 通常債務引受け<br>(スタート+エンド) | エンドのみ<br>債務引受け | 合計            | 通常債務引受け<br>(スタート+エンド) | エンドのみ<br>債務引受け |
| 2014   | 2,229,762,646 | 21,132,368,325 | 21,010,799,665        | 121,568,660    | 355,668,760   | 355,283,760           | 385,000        |
| 2015   | 1,760,828,979 | 24,290,326,961 | 24,196,837,974        | 93,488,986     | 1,223,924,280 | 1,187,977,440         | 35,946,840     |
| 2016   | 649,974,689   | 12,296,494,583 | 12,252,761,187        | 43,733,396     | 429,569,320   | 425,512,640           | 4,056,680      |
| 15. 06 | 199,859,744   | 2,137,671,674  | 2,130,252,476         | 7,419,198      | 219,789,000   | 214,021,200           | 5,767,800      |
| 15. 07 | 135,086,271   | 2,191,683,825  | 2,185,405,997         | 6,277,828      | 180,465,400   | 173,030,400           | 7,435,000      |
| 15. 08 | 119,814,750   | 2,021,209,772  | 2,016,115,916         | 5,093,856      | 140,468,800   | 135,241,600           | 5,227,200      |
| 15. 09 | 145,304,048   | 1,763,487,264  | 1,759,284,024         | 4,203,240      | 141,000,560   | 135,272,360           | 5,728,200      |
| 15. 10 | 116,098,085   | 1,998,511,427  | 1,984,470,879         | 14,040,548     | 112,815,040   | 108,101,600           | 4,713,440      |
| 15. 11 | 98,370,699    | 1,773,284,102  | 1,766,549,356         | 6,734,746      | 95,027,280    | 92,089,480            | 2,937,800      |
| 15. 12 | 121,762,736   | 2,000,631,436  | 1,994,338,804         | 6,292,632      | 121,746,000   | 118,175,600           | 3,570,400      |
| 16. 01 | 126,017,580   | 2,044,880,462  | 2,039,588,436         | 5,292,026      | 128,618,200   | 126,153,400           | 2,464,800      |
| 16. 02 | 122,798,898   | 2,009,738,094  | 2,004,567,144         | 5,170,950      | 86,011,880    | 84,606,800            | 1,405,080      |
| 16. 03 | 109,741,046   | 1,902,016,468  | 1,896,459,690         | 5,556,778      | 41,666,000    | 41,537,200            | 128,800        |
| 16. 04 | 110,860,798   | 1,952,487,926  | 1,942,175,216         | 10,312,710     | 37,867,640    | 37,865,640            | 2,000          |
| 16. 05 | 80,423,739    | 1,992,660,120  | 1,982,218,704         | 10,441,416     | 63,293,600    | 63,277,600            | 16,000         |
| 16. 06 | 100,132,627   | 2,394,711,512  | 2,387,751,996         | 6,959,516      | 72,112,000    | 72,072,000            | 40,000         |

## II 国債・資金決済

### 1. DVP決済状況

(単位:百万円、件)

| 年月     | 決済日数 | DVP決済高(額面)    |            | DVP決済金額       |            | 件数        |       |
|--------|------|---------------|------------|---------------|------------|-----------|-------|
|        |      |               | 一日平均       |               | 一日平均       |           | 一日平均  |
| 2014   | 244  | 5,531,048,027 | 22,668,230 | 5,678,137,422 | 23,271,055 | 1,382,806 | 5,667 |
| 2015   | 244  | 6,715,510,305 | 27,522,583 | 6,926,516,347 | 28,387,362 | 1,659,104 | 6,800 |
| 2016   | 122  | 3,370,199,101 | 27,624,583 | 3,547,100,907 | 29,074,598 | 847,645   | 6,948 |
| 15. 06 | 22   | 605,635,799   | 27,528,900 | 621,681,145   | 28,258,234 | 149,244   | 6,784 |
| 15. 07 | 22   | 598,303,113   | 27,195,596 | 615,281,388   | 27,967,336 | 147,814   | 6,719 |
| 15. 08 | 21   | 582,464,624   | 27,736,411 | 598,508,254   | 28,500,393 | 141,618   | 6,744 |
| 15. 09 | 19   | 535,519,385   | 28,185,231 | 551,839,724   | 29,044,196 | 131,040   | 6,897 |
| 15. 10 | 21   | 535,487,388   | 25,499,399 | 553,074,065   | 26,336,860 | 133,108   | 6,338 |
| 15. 11 | 19   | 472,602,901   | 24,873,837 | 487,688,468   | 25,667,814 | 117,180   | 6,167 |
| 15. 12 | 21   | 508,313,371   | 24,205,399 | 527,298,951   | 25,109,474 | 129,716   | 6,177 |
| 16. 01 | 19   | 556,880,869   | 29,309,519 | 576,319,351   | 30,332,597 | 137,307   | 7,227 |
| 16. 02 | 20   | 531,425,820   | 26,571,291 | 558,514,973   | 27,925,749 | 135,465   | 6,773 |
| 16. 03 | 22   | 504,304,578   | 22,922,935 | 537,238,864   | 24,419,948 | 133,520   | 6,069 |
| 16. 04 | 20   | 506,214,916   | 25,310,746 | 535,268,860   | 26,763,443 | 130,230   | 6,512 |
| 16. 05 | 19   | 592,615,455   | 31,190,287 | 624,303,123   | 32,858,059 | 144,349   | 7,597 |
| 16. 06 | 22   | 678,757,461   | 30,852,612 | 715,455,733   | 32,520,715 | 166,774   | 7,581 |

【参考】日本銀行におけるDVP決済全体との比較

(単位:百万円、件)

| 年月     | 決済日数 | DVP決済高(額面、一日平均) |            |       | DVP決済件数(一日平均) |        |       |
|--------|------|-----------------|------------|-------|---------------|--------|-------|
|        |      | 当社決済高           | 日本銀行決済高    | 比率    | 当社決済件数        | 日本銀行件数 | 比率    |
| 2014   | 244  | 22,668,230      | 54,228,445 | 41.8% | 5,667         | 13,313 | 42.6% |
| 2015   | 244  | 27,522,583      | 54,754,448 | 50.3% | 6,800         | 13,247 | 51.3% |
| 2016   | 100  | 26,914,416      | 52,537,325 | 51.2% | 6,809         | 13,324 | 51.1% |
| 15. 06 | 22   | 27,528,900      | 54,194,518 | 50.8% | 6,784         | 12,987 | 52.2% |
| 15. 07 | 22   | 27,195,596      | 53,514,605 | 50.8% | 6,719         | 12,880 | 52.2% |
| 15. 08 | 21   | 27,736,411      | 54,409,324 | 51.0% | 6,744         | 12,692 | 53.1% |
| 15. 09 | 19   | 28,185,231      | 55,218,421 | 51.0% | 6,897         | 13,041 | 52.9% |
| 15. 10 | 21   | 25,499,399      | 52,514,157 | 48.6% | 6,338         | 12,759 | 49.7% |
| 15. 11 | 19   | 24,873,837      | 52,148,795 | 47.7% | 6,167         | 12,769 | 48.3% |
| 15. 12 | 21   | 24,205,399      | 52,382,729 | 46.2% | 6,177         | 13,034 | 47.4% |
| 16. 01 | 19   | 29,309,519      | 58,424,458 | 50.2% | 7,227         | 14,083 | 51.3% |
| 16. 02 | 20   | 26,571,291      | 53,526,145 | 49.6% | 6,773         | 13,722 | 49.4% |
| 16. 03 | 22   | 22,922,935      | 46,218,509 | 49.6% | 6,069         | 12,442 | 48.8% |
| 16. 04 | 20   | 25,310,746      | 47,634,285 | 53.1% | 6,512         | 12,431 | 52.4% |
| 16. 05 | 19   | 31,190,287      | 58,086,947 | 53.7% | 7,597         | 14,108 | 53.8% |
| 16. 06 | 22   | 30,852,612      | ...        | ...   | 7,581         | ...    | ...   |

2. FOS決済状況

(単位:百万円)

| 年月     | 決済日数 | FOS決済 決済金額 |        |
|--------|------|------------|--------|
|        |      |            | 一日平均   |
| 2014   | 244  | 4,529,084  | 18,562 |
| 2015   | 244  | 8,360,046  | 34,262 |
| 2016   | 122  | 5,943,269  | 48,715 |
| 15. 06 | 22   | 1,011,787  | 45,990 |
| 15. 07 | 22   | 642,040    | 29,184 |
| 15. 08 | 21   | 508,425    | 24,211 |
| 15. 09 | 19   | 451,225    | 23,749 |
| 15. 10 | 21   | 386,198    | 18,390 |
| 15. 11 | 19   | 251,839    | 13,255 |
| 15. 12 | 21   | 300,028    | 14,287 |
| 16. 01 | 19   | 317,390    | 16,705 |
| 16. 02 | 20   | 1,364,484  | 68,224 |
| 16. 03 | 22   | 1,419,695  | 64,532 |
| 16. 04 | 20   | 1,056,145  | 52,807 |
| 16. 05 | 19   | 607,750    | 31,987 |
| 16. 06 | 22   | 1,177,803  | 53,537 |

3. 時間帯別決済完了状況

(単位:件、分)

|       | 9時～10時  | 10時～11時 | 11時～12時 | 12時～13時 | 13時～   | 決済所要時間 |
|-------|---------|---------|---------|---------|--------|--------|
| 国債受取  | 79,800  | 2,380   | 1,131   | 156     | 20     | 1.8    |
| 国債引渡  | 76,050  | 4,615   | 2,227   | 355     | 40     | 3.3    |
| 合計    | 155,850 | 6,995   | 3,358   | 511     | 60     |        |
| 決済進捗率 | 93.4%   | 97.6%   | 99.6%   | 99.9%   | 100.0% |        |

4. フェイル発生状況

(単位:百万円、件)

| 年月     | 決済日数 | フェイル発生 額面総額 |       | フェイル発生 合計件数 |      |
|--------|------|-------------|-------|-------------|------|
|        |      |             | 一日平均  |             | 一日平均 |
| 2014   | 244  | 639,582     | 2,621 | 178         | 0.7  |
| 2015   | 244  | 735,702     | 3,015 | 188         | 0.8  |
| 2016   | 122  | 287,856     | 2,359 | 92          | 0.8  |
| 15. 06 | 22   | 76,230      | 3,465 | 17          | 0.8  |
| 15. 07 | 22   | 1,000       | 45    | 1           | 0.0  |
| 15. 08 | 21   | 40,000      | 1,905 | 8           | 0.4  |
| 15. 09 | 19   | 55,744      | 2,934 | 17          | 0.9  |
| 15. 10 | 21   | 21,100      | 1,005 | 9           | 0.4  |
| 15. 11 | 19   | 10,000      | 526   | 2           | 0.1  |
| 15. 12 | 21   | 74,015      | 3,525 | 19          | 0.9  |
| 16. 01 | 19   | 11,000      | 579   | 3           | 0.2  |
| 16. 02 | 20   | 33,917      | 1,696 | 13          | 0.7  |
| 16. 03 | 22   | 105,370     | 4,790 | 32          | 1.5  |
| 16. 04 | 20   | 69,779      | 3,489 | 22          | 1.1  |
| 16. 05 | 19   | 27,400      | 1,442 | 8           | 0.4  |
| 16. 06 | 22   | 40,388      | 1,836 | 14          | 0.6  |

### Ⅲ ネットティング効果

(単位:百万円)

| 年月     | 決済日数 | DVP決済高(額面)    |            | 債務引受高(額面)      |             | ネットティング後<br>決済比率 |
|--------|------|---------------|------------|----------------|-------------|------------------|
|        |      |               | 一日平均       |                | 一日平均        |                  |
| 2014   | 244  | 5,531,048,077 | 22,668,230 | 23,676,658,622 | 97,035,486  | 23.4%            |
| 2015   | 244  | 6,715,510,305 | 27,522,583 | 27,256,935,674 | 111,708,753 | 24.6%            |
| 2016   | 122  | 3,370,245,158 | 27,624,960 | 13,339,229,824 | 109,337,949 | 25.3%            |
| 15. 06 | 22   | 605,635,799   | 27,528,900 | 2,550,698,762  | 115,940,853 | 23.7%            |
| 15. 07 | 22   | 598,303,113   | 27,195,596 | 2,528,587,358  | 114,935,789 | 23.7%            |
| 15. 08 | 21   | 582,464,624   | 27,736,411 | 2,257,559,540  | 107,502,835 | 25.8%            |
| 15. 09 | 19   | 535,584,123   | 28,188,638 | 2,051,881,715  | 107,993,774 | 26.1%            |
| 15. 10 | 21   | 535,422,650   | 25,496,317 | 2,258,500,697  | 107,547,652 | 23.7%            |
| 15. 11 | 19   | 472,602,901   | 24,873,837 | 1,954,890,220  | 102,888,959 | 24.2%            |
| 15. 12 | 21   | 508,313,371   | 24,205,399 | 2,266,542,645  | 107,930,602 | 22.4%            |
| 16. 01 | 19   | 556,882,869   | 29,309,625 | 2,251,990,091  | 118,525,794 | 24.7%            |
| 16. 02 | 20   | 531,423,820   | 26,571,191 | 2,264,096,566  | 113,204,828 | 23.5%            |
| 16. 03 | 22   | 504,304,578   | 22,922,935 | 2,080,092,362  | 94,549,653  | 24.2%            |
| 16. 04 | 20   | 506,260,916   | 25,313,046 | 2,064,151,385  | 103,207,569 | 24.5%            |
| 16. 05 | 19   | 592,609,455   | 31,189,971 | 2,151,391,581  | 113,231,136 | 27.5%            |
| 16. 06 | 22   | 678,763,518   | 30,852,887 | 2,527,507,837  | 114,886,720 | 26.9%            |

(単位:百万円)

| 年月     | 決済日数 | DVP決済金額       |            | 債務引受金額         |             | ネットティング後<br>決済比率 |
|--------|------|---------------|------------|----------------|-------------|------------------|
|        |      |               | 一日平均       |                | 一日平均        |                  |
| 2014   | 244  | 5,678,137,472 | 23,271,055 | 24,384,124,043 | 99,934,935  | 23.3%            |
| 2015   | 244  | 6,926,516,347 | 28,387,362 | 28,353,951,197 | 116,204,718 | 24.4%            |
| 2016   | 122  | 3,547,147,184 | 29,074,977 | 14,197,482,639 | 116,372,809 | 25.0%            |
| 15. 06 | 22   | 621,681,145   | 28,258,234 | 2,635,551,154  | 119,797,780 | 23.6%            |
| 15. 07 | 22   | 615,281,388   | 27,967,336 | 2,616,954,790  | 118,952,490 | 23.5%            |
| 15. 08 | 21   | 598,508,254   | 28,500,393 | 2,341,108,224  | 111,481,344 | 25.6%            |
| 15. 09 | 19   | 551,913,981   | 29,048,104 | 2,135,425,569  | 112,390,819 | 25.8%            |
| 15. 10 | 21   | 552,999,808   | 26,333,324 | 2,359,897,857  | 112,376,088 | 23.4%            |
| 15. 11 | 19   | 487,688,468   | 25,667,814 | 2,042,184,802  | 107,483,411 | 23.9%            |
| 15. 12 | 21   | 527,298,951   | 25,109,474 | 2,371,177,374  | 112,913,208 | 22.2%            |
| 16. 01 | 19   | 576,321,464   | 30,332,709 | 2,353,562,598  | 123,871,716 | 24.5%            |
| 16. 02 | 20   | 558,512,860   | 27,925,643 | 2,403,428,498  | 120,171,425 | 23.2%            |
| 16. 03 | 22   | 537,238,864   | 24,419,948 | 2,239,660,131  | 101,802,733 | 24.0%            |
| 16. 04 | 20   | 535,314,860   | 26,765,743 | 2,204,751,424  | 110,237,571 | 24.3%            |
| 16. 05 | 19   | 624,297,123   | 32,857,743 | 2,295,848,501  | 120,834,132 | 27.2%            |
| 16. 06 | 22   | 715,462,011   | 32,521,001 | 2,700,231,484  | 122,737,795 | 26.5%            |