

統計データ (国債店頭取引)

2016年4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	81	8,672,704,995	107,070,432	9,221,249,700	113,842,589	953,188	11,768
15. 04	21	2,340,371,603	111,446,267	2,438,624,339	116,124,969	250,978	11,951
15. 05	18	2,112,581,772	117,365,654	2,188,125,459	121,562,526	226,318	12,573
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

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 (スタート+エンド)	エンドのみ 債務引受け	合計	通常債務引受け (スタート+エンド)	エンドのみ 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	469,418,323	7,909,122,951	7,882,790,487	26,332,464	294,163,720	290,163,040	4,000,680
15. 04	162,325,591	2,132,658,812	2,125,820,444	6,838,368	45,387,200	45,377,200	10,000
15. 05	150,540,592	1,914,561,380	1,905,609,210	8,952,170	47,479,800	47,066,800	413,000
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

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	81	2,098,826,184	25,911,434	2,207,342,050	27,251,136	536,522	6,624
15. 04	21	600,840,161	28,611,436	620,649,742	29,554,750	150,035	7,145
15. 05	18	519,999,967	28,888,887	534,313,725	29,684,096	127,329	7,074
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

【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	61	26,108,381	52,416,308	49.8%	6,661	13,373	49.8%
15. 04	21	28,611,436	55,375,705	51.7%	7,145	13,509	52.9%
15. 05	18	28,888,887	56,975,522	50.7%	7,074	13,770	51.4%
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	...	...	6,512	...	...

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	81	4,157,715	51,330
15. 04	21	567,171	27,008
15. 05	18	868,888	48,272
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

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	63,452	1,311	353	225	20	1.8
国債引渡	60,290	3,149	914	459	57	2.9
合計	123,742	4,460	1,267	684	77	
決済進捗率	95.0%	98.4%	99.4%	99.9%	99.9%	

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	81	220,067	2,717	70	0.9
15. 04	21	17,650	840	5	0.2
15. 05	18	38,876	2,160	16	0.9
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

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 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	81	2,098,872,184	25,912,002	8,660,330,405	106,917,659	24.2%
15. 04	21	600,839,071	28,611,384	2,336,913,392	111,281,590	25.7%
15. 05	18	519,999,967	28,888,887	2,102,371,472	116,798,415	24.7%
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%

(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 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	81	2,207,388,050	27,251,704	9,201,402,653	113,597,564	24.0%
15. 04	21	620,648,445	29,554,688	2,434,532,251	115,930,107	25.5%
15. 05	18	534,313,725	29,684,096	2,180,018,475	121,112,138	24.5%
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%