

統計データ (国債店頭取引)

2015年9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
2013	245	20,387,678,358	83,215,014	20,976,420,186	85,618,042	2,192,392	8,949
2014	244	23,717,799,731	97,204,097	24,432,474,098	100,133,091	2,316,802	9,495
2015	183	20,836,833,412	113,862,478	21,642,450,274	118,264,756	2,089,380	11,417
14. 09	20	2,198,905,654	109,945,283	2,271,031,715	113,551,586	218,644	10,932
14. 10	22	2,596,838,541	118,038,116	2,684,533,183	122,024,236	253,002	11,500
14. 11	18	1,960,834,025	108,935,224	2,041,180,567	113,398,920	213,436	11,858
14. 12	21	2,057,310,034	97,967,145	2,146,582,514	102,218,215	235,798	11,228
15. 01	19	2,208,386,481	116,230,867	2,317,829,043	121,991,002	223,040	11,739
15. 02	19	2,292,867,301	120,677,226	2,381,959,090	125,366,268	230,548	12,134
15. 03	22	2,486,785,142	113,035,688	2,576,981,544	117,135,525	243,384	11,063
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

2. 取引種別債務引受高(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
2013	1,841,511,237	18,088,432,533	18,011,632,302	76,800,231	457,734,588	452,573,988	5,160,600
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	1,424,597,457	18,517,899,995	18,451,478,934	66,421,060	894,335,960	869,610,760	24,725,200
14. 09	180,320,221	1,992,172,633	1,984,214,341	7,958,292	26,412,800	26,332,800	80,000
14. 10	258,858,167	2,309,621,974	2,302,259,324	7,362,650	28,358,400	28,338,400	20,000
14. 11	152,720,595	1,780,288,230	1,772,006,616	8,281,614	27,825,200	27,676,000	149,200
14. 12	175,044,764	1,847,547,870	1,837,295,644	10,252,226	34,717,400	34,716,800	600
15. 01	173,816,934	1,997,665,946	1,987,225,340	10,440,606	36,903,600	36,893,600	10,000
15. 02	167,487,699	2,085,689,602	2,077,193,198	8,496,404	39,690,000	39,618,000	72,000
15. 03	170,361,823	2,273,271,718	2,264,572,328	8,699,390	43,151,600	43,089,600	62,000
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

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
2013	245	4,304,833,145	17,570,748	4,407,214,929	17,988,632	1,118,692	4,566
2014	244	5,531,048,027	22,668,230	5,678,137,422	23,271,055	1,382,806	5,667
2015	183	5,199,106,644	28,410,419	5,358,454,862	29,281,174	1,279,100	6,990
14. 09	20	525,449,388	26,272,469	541,104,136	27,055,207	132,730	6,637
14. 10	22	623,708,623	28,350,392	642,762,039	29,216,456	154,240	7,011
14. 11	18	489,279,636	27,182,202	506,903,124	28,161,285	123,182	6,843
14. 12	21	555,525,465	26,453,594	576,314,497	27,443,547	141,022	6,715
15. 01	19	550,331,901	28,964,837	573,342,682	30,175,931	135,864	7,151
15. 02	19	588,031,011	30,949,001	605,492,242	31,868,013	142,781	7,515
15. 03	22	617,980,679	28,090,031	637,345,956	28,970,271	153,375	6,972
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

【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
2013	245	17,570,748	44,127,598	39.8%	4,566	11,541	39.6%
2014	244	22,668,230	54,228,445	41.8%	5,667	13,313	42.6%
2015	164	28,436,508	55,593,132	51.2%	7,000	13,416	52.2%
14. 09	20	26,272,469	55,399,715	47.4%	6,637	13,782	48.2%
14. 10	22	28,350,392	58,058,091	48.8%	7,011	14,007	50.1%
14. 11	18	27,182,202	58,968,622	46.1%	6,843	14,517	47.1%
14. 12	21	26,453,594	54,360,900	48.7%	6,715	13,639	49.2%
15. 01	19	28,964,837	57,538,274	50.3%	7,151	13,916	51.4%
15. 02	19	30,949,001	59,017,658	52.4%	7,515	14,123	53.2%
15. 03	22	28,090,031	54,639,327	51.4%	6,972	13,655	51.1%
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	...	...	6,897	...	...

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
2013	245	5,814,230	23,732
2014	244	4,529,084	18,562
2015	183	7,421,979	40,557
14. 09	20	438,186	21,909
14. 10	22	378,342	17,197
14. 11	18	918,632	51,035
14. 12	21	552,543	26,312
15. 01	19	933,209	49,116
15. 02	19	1,128,655	59,403
15. 03	22	1,310,576	59,572
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

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	63,064	1,634	752	202	84	4.7
国債引渡	59,847	3,263	1,532	453	209	4.1
合計	122,911	4,897	2,284	655	293	
決済進捗率	93.8%	97.5%	99.2%	99.7%	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
2013	245	556,260	2,270	168	0.7
2014	244	639,582	2,621	178	0.7
2015	183	630,587	3,446	158	0.9
14. 09	20	43,839	2,192	15	0.8
14. 10	22	26,432	1,201	8	0.4
14. 11	18	14,100	783	6	0.3
14. 12	21	85,680	4,080	22	1.0
15. 01	19	248,690	13,089	56	2.9
15. 02	19	55,034	2,897	13	0.7
15. 03	22	97,363	4,426	25	1.1
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

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	
2013	245	4,304,853,145	17,570,829	20,376,510,347	83,169,430	21.1%
2014	244	5,531,048,077	22,668,230	23,676,658,622	97,035,486	23.4%
2015	183	5,199,171,382	28,410,773	20,777,002,112	113,535,531	25.0%
14. 09	20	525,448,418	26,272,421	2,176,604,951	108,830,248	24.1%
14. 10	22	623,708,623	28,350,392	2,589,835,365	117,719,789	24.1%
14. 11	18	489,283,436	27,182,413	1,999,447,609	111,080,423	24.5%
14. 12	21	555,521,665	26,453,413	2,087,031,102	99,382,433	26.6%
15. 01	19	550,331,901	28,964,837	2,156,980,490	113,525,289	25.5%
15. 02	19	588,031,011	30,949,001	2,275,437,948	119,759,892	25.8%
15. 03	22	617,981,769	28,090,080	2,516,571,432	114,389,611	24.6%
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%

(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	
2013	245	4,407,234,927	17,988,714	20,965,252,940	85,572,461	21.0%
2014	244	5,678,137,472	23,271,055	24,384,124,043	99,934,935	23.3%
2015	183	5,358,529,119	29,281,580	21,580,691,163	117,927,274	24.8%
14. 09	20	541,103,162	27,055,158	2,247,747,189	112,387,359	24.1%
14. 10	22	642,762,039	29,216,456	2,677,943,804	121,724,718	24.0%
14. 11	18	506,907,410	28,161,523	2,078,834,904	115,490,828	24.4%
14. 12	21	576,310,210	27,443,343	2,176,142,219	103,625,820	26.5%
15. 01	19	573,342,682	30,175,931	2,264,398,699	119,178,879	25.3%
15. 02	19	605,492,242	31,868,013	2,365,489,092	124,499,426	25.6%
15. 03	22	637,347,253	28,970,330	2,607,212,904	118,509,677	24.4%
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%