

統計データ (国債店頭取引)

2014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。
 - 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
2012	248	21,977,539,286	88,619,110	22,613,139,777	91,182,015	2,430,478	9,800
2013	245	20,387,678,358	83,215,014	20,976,420,186	85,618,042	2,192,392	8,949
2014	183	17,102,817,130	93,458,017	17,560,177,832	95,957,256	1,614,566	8,823
13. 09	19	1,498,333,500	78,859,658	1,539,584,422	81,030,759	167,344	8,808
13. 10	22	1,925,663,880	87,530,176	1,983,002,696	90,136,486	186,080	8,458
13. 11	20	1,529,804,965	76,490,248	1,570,498,491	78,524,925	151,712	7,586
13. 12	20	1,509,603,626	75,480,181	1,545,959,215	77,297,961	152,654	7,633
14. 01	19	1,553,819,395	81,779,968	1,590,009,558	83,684,714	153,298	8,068
14. 02	19	1,445,002,141	76,052,744	1,482,815,043	78,042,897	146,014	7,685
14. 03	20	1,625,552,783	81,277,639	1,664,272,642	83,213,632	151,690	7,585
14. 04	21	1,951,523,063	92,929,670	1,991,463,186	94,831,580	164,660	7,841
14. 05	20	1,720,889,073	86,044,454	1,757,865,732	87,893,287	149,476	7,474
14. 06	21	1,740,920,048	82,900,955	1,782,164,331	84,864,968	168,308	8,015
14. 07	22	2,561,969,825	116,453,174	2,636,610,165	119,845,917	238,860	10,857
14. 08	21	2,304,235,145	109,725,483	2,383,945,457	113,521,212	223,616	10,648
14. 09	20	2,198,905,654	109,945,283	2,271,031,715	113,551,586	218,644	10,932

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
2012	2,305,160,408	18,848,327,438	18,756,679,342	91,648,096	824,031,360	818,278,160	5,753,200
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	1,643,139,118	15,194,910,251	15,099,238,081	95,672,170	264,767,760	264,552,560	215,200
13. 09	157,189,150	1,311,955,029	1,307,468,020	4,487,009	29,189,320	29,123,320	66,000
13. 10	168,321,800	1,721,084,800	1,710,251,824	10,832,976	36,257,280	36,256,880	400
13. 11	147,629,533	1,359,283,192	1,357,033,688	2,249,504	22,892,240	22,872,240	20,000
13. 12	158,150,987	1,325,306,038	1,318,572,792	6,733,246	26,146,600	26,116,600	30,000
14. 01	164,700,547	1,356,959,408	1,346,966,024	9,993,384	32,159,440	32,156,440	3,000
14. 02	162,919,775	1,247,302,766	1,235,455,580	11,847,186	34,779,600	34,779,600	0
14. 03	161,476,823	1,432,513,560	1,424,037,056	8,476,504	31,562,400	31,562,400	0
14. 04	190,365,611	1,731,862,652	1,726,201,092	5,661,560	29,294,800	29,284,800	10,000
14. 05	179,897,101	1,518,594,652	1,511,195,052	7,399,600	22,397,320	22,387,320	10,000
14. 06	173,780,120	1,539,829,928	1,508,839,280	30,990,648	27,310,000	27,215,200	94,800
14. 07	237,344,561	2,293,220,264	2,287,004,824	6,215,440	31,405,000	31,403,200	1,800
14. 08	192,334,357	2,082,454,388	2,075,324,832	7,129,556	29,446,400	29,430,800	15,600
14. 09	180,320,221	1,992,172,633	1,984,214,341	7,958,292	26,412,800	26,332,800	80,000

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
2012	248	4,697,852,071	18,942,952	4,829,309,823	19,473,023	1,233,992	4,976
2013	245	4,304,833,145	17,570,748	4,407,214,929	17,988,632	1,118,692	4,566
2014	183	3,862,534,302	21,106,745	3,952,157,761	21,596,490	964,362	5,270
13. 09	19	317,181,447	16,693,760	324,064,377	17,056,020	82,621	4,348
13. 10	22	396,785,531	18,035,706	406,665,467	18,484,794	102,102	4,641
13. 11	20	329,336,261	16,466,813	335,789,160	16,789,458	84,372	4,219
13. 12	20	357,174,513	17,858,726	363,895,593	18,194,780	90,451	4,523
14. 01	19	343,915,958	18,100,840	350,275,814	18,435,569	86,561	4,556
14. 02	19	330,009,551	17,368,924	336,596,418	17,715,601	83,011	4,369
14. 03	20	377,780,957	18,889,048	385,472,078	19,273,604	93,886	4,694
14. 04	21	409,783,696	19,513,509	417,527,050	19,882,240	101,945	4,855
14. 05	20	369,627,976	18,481,399	376,490,188	18,824,509	90,792	4,540
14. 06	21	385,393,197	18,352,057	392,617,748	18,696,083	95,425	4,544
14. 07	22	587,289,792	26,694,991	602,005,758	27,363,898	146,505	6,659
14. 08	21	533,283,781	25,394,466	550,068,566	26,193,741	133,507	6,357
14. 09	20	525,449,388	26,272,469	541,104,136	27,055,207	132,730	6,637

【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
2012	248	18,942,952	41,678,345	45.5%	4,976	11,045	45.1%
2013	245	17,570,748	44,127,598	39.8%	4,566	11,541	39.6%
2014	163	20,472,914	53,027,326	38.6%	5,102	12,987	39.3%
13. 09	19	16,693,760	44,529,937	37.5%	4,348	11,460	37.9%
13. 10	22	18,035,706	47,037,550	38.3%	4,641	11,893	39.0%
13. 11	20	16,466,813	45,353,745	36.3%	4,219	11,391	37.0%
13. 12	20	17,858,726	48,370,640	36.9%	4,523	12,253	36.9%
14. 01	19	18,100,840	50,339,726	36.0%	4,556	12,332	36.9%
14. 02	19	17,368,924	50,349,437	34.5%	4,369	12,501	34.9%
14. 03	20	18,889,048	53,216,150	35.5%	4,694	13,152	35.7%
14. 04	21	19,513,509	54,694,052	35.7%	4,855	13,490	36.0%
14. 05	20	18,481,399	52,169,385	35.4%	4,540	12,573	36.1%
14. 06	21	18,352,057	52,071,248	35.2%	4,544	12,707	35.8%
14. 07	22	26,694,991	56,049,223	47.6%	6,659	13,782	48.3%
14. 08	21	25,394,466	54,642,629	46.5%	6,357	13,200	48.2%
14. 09	20	26,272,469	...	...	6,637	...	...

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
2012	248	3,303,075	13,319
2013	245	5,814,230	23,732
2014	183	2,679,566	14,642
13. 09	19	406,893	21,415
13. 10	22	324,304	14,741
13. 11	20	213,836	10,692
13. 12	20	271,765	13,588
14. 01	19	379,322	19,964
14. 02	19	236,688	12,457
14. 03	20	243,069	12,153
14. 04	21	254,445	12,116
14. 05	20	163,121	8,156
14. 06	21	319,257	15,203
14. 07	22	304,864	13,857
14. 08	21	340,610	16,220
14. 09	20	438,186	21,909

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	62,894	2,581	770	158	44	3.8
国債引渡	58,882	5,180	1,726	387	108	3.5
合計	121,776	7,761	2,496	545	152	
決済進捗率	91.7%	97.6%	99.4%	99.8%	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
2012	248	360,713	1,454	87	0.4
2013	245	556,260	2,270	168	0.7
2014	183	513,370	2,805	142	0.8
13. 09	19	78,373	4,125	28	1.5
13. 10	22	49,310	2,241	12	0.5
13. 11	20	24,805	1,240	12	0.6
13. 12	20	88,800	4,440	21	1.1
14. 01	19	17,920	943	7	0.4
14. 02	19	32,500	1,711	8	0.4
14. 03	20	342,269	17,113	79	4.0
14. 04	21	8,252	393	4	0.2
14. 05	20	2,000	100	5	0.3
14. 06	21	15,201	724	5	0.2
14. 07	22	9,476	431	7	0.3
14. 08	21	41,910	1,996	12	0.6
14. 09	20	43,839	2,192	15	0.8

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	
2012	248	4,697,852,271	18,942,953	22,046,787,896	88,898,338	21.3%
2013	245	4,304,853,145	17,570,829	20,376,510,347	83,169,430	21.1%
2014	183	3,862,534,352	21,106,745	17,000,344,545	92,898,058	22.7%
13. 09	19	317,181,447	16,693,760	1,489,265,362	78,382,388	21.3%
13. 10	22	396,785,531	18,035,706	1,935,718,935	87,987,224	20.5%
13. 11	20	329,336,261	16,466,813	1,540,292,771	77,014,639	21.4%
13. 12	20	357,174,513	17,858,726	1,519,075,970	75,953,799	23.5%
14. 01	19	343,915,958	18,100,840	1,536,315,819	80,858,727	22.4%
14. 02	19	330,009,551	17,368,924	1,445,867,272	76,098,277	22.8%
14. 03	20	377,939,557	18,896,978	1,608,561,714	80,428,086	23.5%
14. 04	21	409,625,096	19,505,957	1,983,031,937	94,430,092	20.7%
14. 05	20	369,627,976	18,481,399	1,694,178,441	84,708,922	21.8%
14. 06	21	385,394,601	18,352,124	1,698,884,576	80,899,266	22.7%
14. 07	22	587,288,389	26,694,927	2,547,033,285	115,774,240	23.1%
14. 08	21	533,284,801	25,394,514	2,309,866,546	109,993,645	23.1%
14. 09	20	525,448,418	26,272,421	2,176,604,951	108,830,248	24.1%

(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	
2012	248	4,829,310,025	19,473,024	22,683,499,909	91,465,725	21.3%
2013	245	4,407,234,927	17,988,714	20,965,252,940	85,572,461	21.0%
2014	183	3,952,157,811	21,596,491	17,451,203,115	95,361,766	22.6%
13. 09	19	324,064,377	17,056,020	1,530,427,758	80,548,829	21.2%
13. 10	22	406,665,467	18,484,794	1,993,484,292	90,612,922	20.4%
13. 11	20	335,789,160	16,789,458	1,581,899,115	79,094,956	21.2%
13. 12	20	363,895,593	18,194,780	1,555,727,597	77,786,380	23.4%
14. 01	19	350,275,814	18,435,569	1,572,286,915	82,751,943	22.3%
14. 02	19	336,596,418	17,715,601	1,483,060,310	78,055,806	22.7%
14. 03	20	385,638,201	19,281,910	1,647,188,733	82,359,437	23.4%
14. 04	21	417,360,927	19,874,330	2,024,339,023	96,397,096	20.6%
14. 05	20	376,490,188	18,824,509	1,730,573,266	86,528,663	21.8%
14. 06	21	392,619,264	18,696,155	1,736,176,559	82,675,074	22.6%
14. 07	22	602,004,243	27,363,829	2,620,675,210	119,121,600	23.0%
14. 08	21	550,069,590	26,193,790	2,389,155,907	113,769,329	23.0%
14. 09	20	541,103,162	27,055,158	2,247,747,189	112,387,359	24.1%