

統計データ  
(国債店頭取引)

2013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	1
➢ 国債・資金決済	2
➢ ネッティング効果	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。）
- 債務引受について
  - 債務引受は申込み日を基準に、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。
  - 現先取引及び貸借取引は、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、エンドのみ引受の場合は、エンド取引のみ対象としております。
- 【参考1】については、以下の通りです。
  - 市場取引高は日本証券業協会調べです。
  - 債務引受は申込み日を基準に、売り手・買い手（貸し手・借り手）双方からの額面を合計しております。
  - 現先取引は、スタート取引及びエンド取引について額面の合計となっております。
  - 貸借取引は、スタート取引のみ対象としております。また、エンドのみ引受の場合はエンド取引のみ対象としております。
- 国債・資金決済について
  - DVP決済は、債務引受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、当社の国債受取及び引渡の両方について、額面、金額、件数を合計しております。
  - フェイル分については完了日に集計し、ペアオフネッティングを行った場合は対象外です。
  - FOS決済は、決済日をベースに集計しております。当社の受取及び支払の両方についての金額の合計です。
  - フェイル発生については、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2】におけるDVP決済件数は、日本銀行調べです。
- ネッティング効果について
  - 債務引受は決済日を基準に、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。
  - 現先取引及び貸借取引は、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。
  - エンドのみ引受の場合については、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（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。）当社の国債受取及び引渡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。【参考1】及び【参考2】の一部の項目は、外部データを必要とするため、1か月遅れでの掲載になります。
- 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

(額面及び決済金額については単位:百万円)

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	一日平均	一日平均	一日平均
2011	245	17,250,314,001	70,409,445	17,593,093,282	71,808,544	2,388,436	9,749
2012	248	21,977,539,281	88,619,110	22,613,139,772	91,182,015	2,430,478	9,800
2013	183	15,422,605,885	84,276,535	15,876,959,782	86,759,343	1,701,946	9,300
12. 09	19	1,696,794,647	89,304,981	1,747,450,063	91,971,056	177,116	9,322
12. 10	22	1,813,515,295	82,432,513	1,869,301,857	84,968,266	184,836	8,402
12. 11	21	1,711,908,708	81,519,462	1,768,075,729	84,194,082	176,808	8,419
12. 12	19	1,373,621,824	72,295,885	1,419,027,616	74,685,664	154,442	8,129
13. 01	19	1,683,094,277	88,583,909	1,724,603,629	90,768,612	167,712	8,827
13. 02	19	1,540,328,835	81,069,939	1,585,177,570	83,430,398	169,478	8,920
13. 03	20	1,696,874,085	84,843,704	1,765,816,154	88,290,808	194,074	9,704
13. 04	21	2,045,531,854	97,406,279	2,126,089,639	101,242,364	227,160	10,817
13. 05	21	1,799,454,422	85,688,306	1,849,967,690	88,093,700	211,404	10,067
13. 06	20	1,702,411,210	85,120,561	1,742,852,586	87,142,629	199,230	9,962
13. 07	22	1,770,782,376	80,490,108	1,811,356,068	82,334,367	190,106	8,641
13. 08	22	1,685,795,322	76,627,060	1,731,512,019	78,705,092	175,438	7,974
13. 09	19	1,498,333,500	78,859,658	1,539,584,422	81,030,759	167,344	8,808

【参考1】市場全体の取引高との比較

	2013年9月			2013年8月			2013年7月	
	債務引受高	市場取引高	比率	債務引受高	市場取引高	比率	比率	比率
売買取引	157,189,150			140,796,893	249,276,200	56.5%	59.0%	
現先取引	29,123,320			34,319,028	555,533,500	6.2%	7.3%	
現先取引(エンドのみ)	66,000			161,600				
貸借取引	653,734,010			750,996,847	969,339,200	78.4%	78.7%	
貸借取引(エンドのみ)	4,487,009			8,524,106				

## II 国債・資金決済

### (1) DVP決済状況

(額面及び決済金額については単位:百万円)

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	一日平均	一日平均	一日平均
2011	245	4,051,478,703	16,536,648	4,129,636,516	16,855,659	1,079,538	4,406
2012	248	4,697,852,067	18,942,952	4,829,309,818	19,473,023	1,233,992	4,976
2013	183	3,221,536,839	17,604,026	3,300,864,708	18,037,512	841,767	4,600
12. 09	19	369,402,747	19,442,250	380,242,831	20,012,781	95,674	5,035
12. 10	22	409,655,119	18,620,687	420,523,570	19,114,708	106,200	4,827
12. 11	21	394,075,944	18,765,521	405,136,823	19,292,230	101,488	4,833
12. 12	19	350,091,300	18,425,858	360,508,228	18,974,117	90,268	4,751
13. 01	19	392,141,679	20,639,036	400,793,843	21,094,413	98,080	5,162
13. 02	19	329,830,648	17,359,508	337,640,508	17,770,553	85,342	4,492
13. 03	20	371,565,143	18,578,257	383,820,065	19,191,003	98,990	4,950
13. 04	21	445,841,891	21,230,566	460,193,812	21,913,991	113,611	5,410
13. 05	21	354,514,580	16,881,647	363,364,635	17,303,078	94,455	4,498
13. 06	20	340,970,983	17,048,549	348,705,441	17,435,272	91,834	4,592
13. 07	22	352,678,463	16,030,839	359,446,673	16,338,485	92,898	4,223
13. 08	22	316,812,001	14,400,546	322,835,351	14,674,334	83,936	3,815
13. 09	19	317,181,447	16,693,760	324,064,377	17,056,020	82,621	4,348

【参考2】日本銀行におけるDVP決済全体との比較

年月	決済日数	DVP決済件数(一日平均)		
		当社決済件数	日本銀行件数	比率
2011	245	4,406	10,294	42.8%
2012	248	4,976	11,045	45.1%
2013	164	4,629	11,434	40.5%
12. 09	19	5,035	10,964	45.9%
12. 10	22	4,827	10,685	45.2%
12. 11	21	4,833	10,352	46.7%
12. 12	19	4,751	10,848	43.8%
13. 01	19	5,162	11,349	45.5%
13. 02	19	4,492	10,730	41.9%
13. 03	20	4,950	12,247	40.4%
13. 04	21	5,410	13,355	40.5%
13. 05	21	4,498	11,594	38.8%
13. 06	20	4,592	11,521	39.9%
13. 07	22	4,223	10,807	39.1%
13. 08	22	3,815	9,940	38.4%
13. 09	19	4,348		

(2)FOS決済状況 (決済金額については単位:百万円)

年月	決済日数	FOS決済	決済金額	
			一日平均	
2011	245	3,668,024	14,972	
2012	248	3,303,069	13,319	
2013	183	5,004,322	27,346	
12. 09	19	271,897	14,310	
12. 10	22	211,421	9,610	
12. 11	21	170,424	8,115	
12. 12	19	220,544	11,608	
13. 01	19	270,634	14,244	
13. 02	19	317,866	16,730	
13. 03	20	583,313	29,166	
13. 04	21	1,085,333	51,683	
13. 05	21	816,949	38,902	
13. 06	20	702,026	35,101	
13. 07	22	392,860	17,857	
13. 08	22	428,445	19,475	
13. 09	19	406,893	21,415	

(3)時間帯別決済完了状況 (国債受取・引渡・合計は単位:件数、決済所要時間は単位: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	36,912	3,709	649	176	35	12.3
国債引渡	33,914	5,368	1,419	344	95	1.2
合計	70,826	9,077	2,068	520	130	
決済進捗率	85.6%	96.6%	99.1%	99.7%	99.9%	

(4) フェイル発生状況

(額面については単位:百万円)

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
2011	245	270,509	1,104	69	0.3
2012	248	360,713	1,454	87	0.4
2013	183	393,345	2,149	123	0.7
12. 09	19	16,000	842	4	0.2
12. 10	22	18,325	833	4	0.2
12. 11	21	0	0	0	0.0
12. 12	19	3,000	158	1	0.1
13. 01	19	75,133	3,954	17	0.9
13. 02	19	10,321	543	4	0.2
13. 03	20	16,443	822	6	0.3
13. 04	21	40,967	1,951	14	0.7
13. 05	21	26,094	1,243	10	0.5
13. 06	20	96,604	4,830	24	1.2
13. 07	22	19,001	864	9	0.4
13. 08	22	30,405	1,382	11	0.5
13. 09	19	78,373	4,125	28	1.5

III ネッティング効果

(額面については単位:百万円)

年月	決済日数	DVP決済高(額面)		債務引受高(額面)		ネッティング後 決済比率
			一日平均		一日平均	
2011	245	4,051,478,703	16,536,648	17,231,468,545	70,332,525	23.5%
2012	248	4,697,852,267	18,942,953	22,046,787,892	88,898,338	21.3%
2013	183	3,221,556,839	17,604,136	15,381,422,670	84,051,490	20.9%
12. 09	19	369,402,747	19,442,250	1,660,606,515	87,400,343	22.2%
12. 10	22	409,655,119	18,620,687	1,873,422,231	85,155,556	21.9%
12. 11	21	394,075,944	18,765,521	1,702,191,050	81,056,717	23.2%
12. 12	19	350,091,300	18,425,858	1,388,576,307	73,082,964	25.2%
13. 01	19	392,141,679	20,639,036	1,675,789,086	88,199,426	23.4%
13. 02	19	329,850,648	17,360,560	1,513,674,589	79,667,084	21.8%
13. 03	20	371,565,143	18,578,257	1,692,465,346	84,623,267	22.0%
13. 04	21	445,844,493	21,230,690	2,061,706,526	98,176,501	21.6%
13. 05	21	354,511,978	16,881,523	1,769,328,109	84,253,719	20.0%
13. 06	20	341,007,312	17,050,366	1,711,389,397	85,569,470	19.9%
13. 07	22	352,642,134	16,029,188	1,789,075,183	81,321,599	19.7%
13. 08	22	316,812,001	14,400,546	1,678,729,068	76,305,867	18.9%
13. 09	19	317,181,447	16,693,760	1,489,265,362	78,382,388	21.3%

(決済金額については単位:百万円)

年月	決済日数	DVP決済金額		債務引受金額		ネッティング後 決済比率
			一日平均		一日平均	
2011	245	4,129,636,517	16,855,659	17,572,001,512	71,722,455	23.5%
2012	248	4,829,310,019	19,473,024	22,683,499,903	91,465,725	21.3%
2013	183	3,300,884,706	18,037,621	15,834,141,935	86,525,366	20.8%
12. 09	19	380,242,831	20,012,781	1,711,078,866	90,056,782	22.2%
12. 10	22	420,523,570	19,114,708	1,930,365,565	87,743,889	21.8%
12. 11	21	405,136,823	19,292,230	1,758,206,602	83,724,124	23.0%
12. 12	19	360,508,228	18,974,117	1,435,045,578	75,528,715	25.1%
13. 01	19	400,793,843	21,094,413	1,717,491,211	90,394,274	23.3%
13. 02	19	337,660,506	17,771,806	1,556,393,053	81,915,424	21.7%
13. 03	20	383,820,065	19,191,003	1,758,562,260	87,928,113	21.8%
13. 04	21	460,196,366	21,914,113	2,144,371,321	102,112,920	21.5%
13. 05	21	363,362,081	17,302,956	1,822,338,388	86,778,019	19.9%
13. 06	20	348,741,074	17,437,054	1,752,167,883	87,608,394	19.9%
13. 07	22	359,411,039	16,336,865	1,829,754,535	83,170,661	19.6%
13. 08	22	322,835,351	14,674,334	1,722,635,521	78,301,615	18.7%
13. 09	19	324,064,377	17,056,020	1,530,427,758	80,548,829	21.2%