

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。）
- 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、ペアオフネット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。
- ネット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 |
| 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

(債務引受高及び市場取引高については単位:百万円)

| | 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 |
| 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 |
| 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 ネットティング効果

(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) | | ネットティング後 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 | | ネットティング後 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 | 17,771,606 | 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% |