

統計月報 平成21年11月

2009年12月25日
株式会社 日本国債清算機関

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
2005	165	5,914,645,303	35,846,335	5,976,205,709	36,219,429	1,067,794	6,471
2006	248	13,973,868,614	56,346,244	13,923,190,752	56,141,898	2,309,332	9,312
2007	245	20,828,928,726	85,016,036	20,903,810,885	85,321,677	2,765,784	11,289
2008	245	20,642,259,890	84,254,122	20,854,215,404	85,119,247	2,742,920	11,196
08. 11	18	1,133,734,482	62,985,249	1,149,517,810	63,862,101	187,944	10,441
08. 12	21	1,352,869,931	64,422,378	1,377,119,725	65,577,130	203,180	9,675
09. 01	19	1,155,801,025	60,831,633	1,182,785,749	62,251,882	177,796	9,358
09. 02	19	1,250,290,029	65,804,738	1,277,854,546	67,255,502	194,378	10,230
09. 03	21	1,145,337,303	54,539,872	1,171,425,292	55,782,157	186,798	8,895
09. 04	21	1,662,323,569	79,158,265	1,688,724,931	80,415,473	196,156	9,341
09. 05	18	1,350,492,863	75,027,381	1,374,193,941	76,344,108	161,484	8,971
09. 06	22	1,419,552,865	64,525,130	1,441,558,532	65,525,388	207,016	9,410
09. 07	22	1,780,305,132	80,922,961	1,815,934,420	82,542,474	212,310	9,650
09. 08	21	1,570,265,020	74,774,525	1,598,777,934	76,132,283	185,166	8,817
09. 09	19	1,287,876,688	67,782,984	1,314,419,599	69,179,979	179,034	9,423
09. 10	21	1,439,191,567	68,532,932	1,466,307,389	69,824,161	198,672	9,461
09. 11	19	1,435,271,999	75,540,632	1,460,202,999	76,852,789	179,898	9,468

注) 2005年の年間値は、当社開業以降の数値(2005年5月から同年12月まで)。以下の計表についても同様。

[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)

	2009年11月			過去2ヶ月の比率推移	
	債務引受高	市場取引高	比率	10月	9月
売買取引	153,474,575	269,779,800	56.9%	59.2%	55.4%
現先取引	50,052,780	330,740,700	15.1%	12.1%	13.4%
現先取引(エンドのみ)	0				
貸借取引	607,882,227	718,629,900	86.8%	82.6%	82.2%
貸借取引(エンドのみ)	15,980,189				

注) 2009年1月より貸借取引の市場取引高はディーリング勘定のみを集計。

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
2005	164	1,482,492,508	9,039,588	1,500,373,895	9,148,621	467,461	2,850
2006	248	3,307,221,186	13,335,569	3,298,619,960	13,300,887	995,828	4,015
2007	245	4,807,647,720	19,623,052	4,820,820,882	19,676,820	1,321,245	5,393
2008	245	4,976,374,980	20,311,735	5,018,218,919	20,482,526	1,339,446	5,467
08. 11	18	323,610,033	17,978,335	327,328,123	18,184,896	89,931	4,996
08. 12	21	408,968,908	19,474,710	415,534,677	19,787,366	111,065	5,289
09. 01	19	333,793,340	17,568,071	340,703,903	17,931,784	90,958	4,787
09. 02	19	330,746,619	17,407,717	337,049,280	17,739,436	90,055	4,740
09. 03	21	352,376,366	16,779,827	358,783,766	17,084,941	98,405	4,686
09. 04	21	407,184,917	19,389,758	412,430,854	19,639,564	110,362	5,255
09. 05	18	331,993,530	18,444,085	336,594,685	18,699,705	89,349	4,964
09. 06	22	389,116,630	17,687,120	394,350,765	17,925,035	106,396	4,836
09. 07	22	412,732,837	18,760,584	419,950,176	19,088,644	109,955	4,998
09. 08	21	370,805,493	17,657,404	377,443,449	17,973,498	98,391	4,685
09. 09	19	344,831,230	18,149,012	351,662,302	18,508,542	92,449	4,866
09. 10	21	394,114,297	18,767,347	400,819,472	19,086,642	104,932	4,997
09. 11	19	344,929,364	18,154,177	350,262,220	18,434,854	90,372	4,756

[参考2] 日本銀行におけるDVP決済全体との比較

	2009年11月			過去2ヶ月の比率推移	
	弊社決済件数	日本銀行件数	比率	10月	9月
DVP決済件数 (一日平均)	4,756	9,728	48.9%	47.6%	46.4%

(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
2005	164	1,701,211	10,373
2006	248	4,185,231	16,876
2007	245	4,584,524	18,712
2008	245	7,746,577	31,619
08. 11	18	353,780	19,654
08. 12	21	462,949	22,045
09. 01	19	431,118	22,690
09. 02	19	323,528	17,028
09. 03	21	247,453	11,783
09. 04	21	435,443	20,735
09. 05	18	267,074	14,837
09. 06	22	438,430	19,929
09. 07	22	317,431	14,429
09. 08	21	361,855	17,231
09. 09	19	304,634	16,033
09. 10	21	287,394	13,685
09. 11	19	337,925	17,786

(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	35,180	9,884	288	5	4	20.1
国債引渡	32,907	11,717	375	6	6	1.4
合計	68,087	21,601	663	11	10	
決済進捗率	75.3%	99.2%	99.9%	99.9%	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	Fェイル発生	額面総額	Fェイル発生	合計件数
			一日平均		一日平均
2005	164	1,310,121	7,989	431	2.6
2006	248	1,733,413	6,990	494	2.0
2007	245	1,842,120	7,519	516	2.1
2008	245	4,054,548	16,549	1,151	4.7
08. 11	18	87,917	4,884	33	1.8
08. 12	21	76,740	3,654	28	1.3
09. 01	19	66,700	3,511	18	0.9
09. 02	19	65,537	3,449	26	1.4
09. 03	21	99,400	4,733	31	1.5
09. 04	21	164,720	7,844	52	2.5
09. 05	18	18,960	1,053	9	0.5
09. 06	22	52,400	2,382	25	1.1
09. 07	22	22,900	1,041	12	0.5
09. 08	21	11,500	548	7	0.3
09. 09	19	14,000	737	4	0.2
09. 10	21	44,830	2,135	13	0.6
09. 11	19	99,770	5,251	24	1.3

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	
2005	164	1,482,530,908	9,039,823	5,781,790,892	35,254,823	25.6%
2006	248	3,307,224,786	13,335,584	13,892,425,005	56,017,843	23.8%
2007	245	4,807,658,120	19,623,094	20,772,656,001	84,786,351	23.1%
2008	245	4,978,838,603	20,321,790	20,738,706,323	84,647,781	24.0%
08. 11	18	323,714,013	17,984,112	1,168,401,734	64,911,207	27.7%
08. 12	21	408,933,628	19,473,030	1,377,665,109	65,603,100	29.7%
09. 01	19	333,803,340	17,568,597	1,126,773,499	59,303,868	29.6%
09. 02	19	330,736,619	17,407,190	1,241,816,770	65,358,777	26.6%
09. 03	21	352,378,766	16,779,941	1,172,789,308	55,847,110	30.0%
09. 04	21	407,202,517	19,390,596	1,613,080,559	76,813,360	25.2%
09. 05	18	331,974,330	18,443,018	1,339,510,500	74,417,250	24.8%
09. 06	22	389,115,830	17,687,083	1,447,908,100	65,814,005	26.9%
09. 07	22	412,732,837	18,760,584	1,739,423,362	79,064,698	23.7%
09. 08	21	370,805,493	17,657,404	1,603,559,635	76,359,983	23.1%
09. 09	19	344,851,030	18,150,054	1,292,919,698	68,048,405	26.7%
09. 10	21	394,094,497	18,766,405	1,422,605,290	67,743,109	27.7%
09. 11	19	344,931,364	18,154,282	1,441,167,855	75,850,940	23.9%

(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	
2005	164	1,500,418,281	9,148,892	5,843,068,447	35,628,466	25.7%
2006	248	3,298,623,612	13,300,902	13,841,384,343	55,812,034	23.8%
2007	245	4,820,831,596	19,676,864	20,845,349,529	85,083,059	23.1%
2008	245	5,020,716,138	20,492,719	20,949,107,130	85,506,560	24.0%
08. 11	18	327,434,598	18,190,811	1,183,341,359	65,741,187	27.7%
08. 12	21	415,499,102	19,785,672	1,401,150,306	66,721,443	29.7%
09. 01	19	340,714,266	17,932,330	1,153,448,439	60,707,813	29.5%
09. 02	19	337,038,916	17,738,890	1,269,259,695	66,803,142	26.6%
09. 03	21	358,786,162	17,085,055	1,199,378,142	57,113,245	29.9%
09. 04	21	412,447,104	19,640,338	1,639,833,052	78,087,288	25.2%
09. 05	18	336,576,862	18,698,715	1,362,845,632	75,713,646	24.7%
09. 06	22	394,349,942	17,924,997	1,470,124,990	66,823,863	26.8%
09. 07	22	419,950,176	19,088,644	1,774,344,211	80,652,010	23.7%
09. 08	21	377,443,449	17,973,498	1,631,824,755	77,705,941	23.1%
09. 09	19	351,682,691	18,509,615	1,319,541,249	69,449,539	26.7%
09. 10	21	400,799,083	19,085,671	1,451,003,933	69,095,425	27.6%
09. 11	19	350,264,198	18,434,958	1,464,959,380	77,103,125	23.9%

以上