

統計月報 平成18年11月

2006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
05. 05	19	449,107,891	23,637,257	459,069,999	24,161,579	100,560	5,293
05. 06	22	640,040,642	29,092,756	654,805,140	29,763,870	129,938	5,906
05. 07	20	613,878,200	30,693,910	625,561,619	31,278,081	110,482	5,524
05. 08	23	863,184,618	37,529,766	871,723,017	37,901,001	152,468	6,629
05. 09	20	816,217,827	40,810,891	825,739,511	41,286,976	138,406	6,920
05. 10	20	848,036,716	42,401,836	850,482,489	42,524,124	145,664	7,283
05. 11	20	851,804,946	42,590,247	854,357,571	42,717,879	152,604	7,630
05. 12	21	832,374,463	39,636,879	834,466,363	39,736,493	137,672	6,556
06. 01	19	788,420,106	41,495,795	792,481,460	41,709,551	135,674	7,141
06. 02	20	849,299,764	42,464,988	849,267,285	42,463,364	163,082	8,154
06. 03	22	1,173,118,724	53,323,578	1,166,020,511	53,000,932	202,588	9,209
06. 04	20	1,200,535,241	60,026,762	1,185,400,664	59,270,033	203,120	10,156
06. 05	20	1,400,986,481	70,049,324	1,387,019,626	69,350,981	209,654	10,483
06. 06	22	1,487,678,325	67,621,742	1,475,933,086	67,087,868	219,672	9,985
06. 07	20	1,174,775,585	58,738,779	1,162,276,279	58,113,814	193,594	9,680
06. 08	23	1,147,650,439	49,897,845	1,143,508,002	49,717,739	204,448	8,889
06. 09	20	1,024,293,270	51,214,664	1,028,139,181	51,406,959	184,594	9,230
06. 10	21	1,113,139,884	53,006,661	1,112,293,742	52,966,369	193,330	9,206
06. 11	20	1,221,302,270	61,065,114	1,223,968,904	61,198,445	192,938	9,647

【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)

	2006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	141,170,959	253,111,700	55.8%	52.2%	52.6%
現先取引	8,815,664	552,207,700	1.6%	2.3%	1.6%
現先取引(エンドのみ)	0				
貸借取引	535,555,466	1,040,580,800	51.5%	47.2%	45.0%
貸借取引(エンドのみ)	204,714				

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
05. 05	18	116,566,631	6,475,924	118,997,657	6,610,981	37,523	2,085
05. 06	22	172,853,304	7,856,968	176,753,188	8,034,236	54,367	2,471
05. 07	20	162,468,916	8,123,446	165,672,991	8,283,650	51,650	2,583
05. 08	23	211,707,963	9,204,694	214,146,475	9,310,716	66,499	2,891
05. 09	20	208,041,312	10,402,066	210,794,825	10,539,741	63,344	3,167
05. 10	20	204,350,692	10,217,535	205,402,794	10,270,140	64,690	3,235
05. 11	20	192,730,540	9,636,527	193,708,329	9,685,416	62,991	3,150
05. 12	21	213,773,150	10,179,674	214,897,636	10,233,221	66,397	3,162
06. 01	19	178,641,661	9,402,193	179,963,449	9,471,760	56,783	2,989
06. 02	20	189,431,313	9,471,566	189,686,337	9,484,317	62,671	3,134
06. 03	22	265,132,119	12,051,460	264,020,473	12,000,931	84,116	3,823
06. 04	20	272,499,266	13,624,963	269,433,365	13,471,668	85,428	4,271
06. 05	20	317,018,635	15,850,932	314,418,320	15,720,916	91,851	4,593
06. 06	22	358,726,519	16,305,751	356,260,328	16,193,651	102,993	4,682
06. 07	20	302,158,494	15,107,925	299,134,959	14,956,748	88,542	4,427
06. 08	23	284,580,809	12,373,079	283,792,098	12,338,787	85,152	3,702
06. 09	20	271,607,695	13,580,385	272,630,240	13,631,512	80,668	4,033
06. 10	21	272,823,619	12,991,601	272,782,715	12,989,653	82,750	3,940
06. 11	20	268,514,988	13,425,749	269,109,805	13,455,490	79,823	3,991

【参考2】日本銀行におけるDVP決済全体との比較

	2006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)	3,991	9,890	40.4%	38.8%	37.8%

(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
05. 05	18	71,938	3,997
05. 06	22	132,829	6,038
05. 07	20	118,582	5,929
05. 08	23	260,967	11,346
05. 09	20	198,485	9,924
05. 10	20	255,598	12,780
05. 11	20	322,237	16,112
05. 12	21	340,575	16,218
06. 01	19	280,038	14,739
06. 02	20	327,390	16,370
06. 03	22	373,510	16,978
06. 04	20	356,198	17,810
06. 05	20	478,914	23,946
06. 06	22	422,651	19,211
06. 07	20	293,982	14,699
06. 08	23	428,142	18,615
06. 09	20	311,486	15,574
06. 10	21	275,567	13,122
06. 11	20	267,010	13,351

(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	27,205	10,808	1,716	365	93	15.2
国債引渡	23,309	13,264	2,392	517	154	2.6
合計	50,514	24,072	4,108	882	247	
決済進捗率	63.2%	93.3%	98.5%	99.6%	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
05. 05	18	399,910	22,217	158	8.8
05. 06	22	109,000	4,955	37	1.7
05. 07	20	73,300	3,665	20	1.0
05. 08	23	187,949	8,172	55	2.4
05. 09	20	88,406	4,420	36	1.8
05. 10	20	121,617	6,081	37	1.9
05. 11	20	93,740	4,687	33	1.7
05. 12	21	236,199	11,248	55	2.6
06. 01	19	100,340	5,281	30	1.6
06. 02	20	108,890	5,445	32	1.6
06. 03	22	116,659	5,303	32	1.5
06. 04	20	181,768	9,088	44	2.2
06. 05	20	141,679	7,084	42	2.1
06. 06	22	144,023	6,547	42	1.9
06. 07	20	181,890	9,095	48	2.4
06. 08	23	115,010	5,000	30	1.3
06. 09	20	132,850	6,643	41	2.1
06. 10	21	236,060	11,241	65	3.1
06. 11	20	140,714	7,036	46	2.3

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ting後 決済比率
			一日平均		一日平均	
05. 05	18	116,585,831	6,476,991	360,156,520	20,008,696	32.4%
05. 06	22	172,870,304	7,857,741	604,796,724	27,490,760	28.6%
05. 07	20	162,479,116	8,123,956	615,490,182	30,774,509	26.4%
05. 08	23	211,722,963	9,205,346	833,859,446	36,254,759	25.4%
05. 09	20	208,016,312	10,400,816	806,087,030	40,304,352	25.8%
05. 10	20	204,405,892	10,220,295	853,607,795	42,680,390	23.9%
05. 11	20	192,705,340	9,635,267	845,605,526	42,280,276	22.8%
05. 12	21	213,745,150	10,178,340	862,187,669	41,056,556	24.8%
06. 01	19	178,639,661	9,402,087	748,779,262	39,409,435	23.9%
06. 02	20	189,447,913	9,472,396	845,941,451	42,297,073	22.4%
06. 03	22	265,131,519	12,051,433	1,122,814,459	51,037,021	23.6%
06. 04	20	272,483,266	13,624,163	1,165,829,364	58,291,468	23.4%
06. 05	20	317,069,035	15,853,452	1,405,135,881	70,256,794	22.6%
06. 06	22	358,676,119	16,303,460	1,493,519,040	67,887,229	24.0%
06. 07	20	302,184,294	15,109,215	1,246,821,064	62,341,053	24.2%
06. 08	23	284,557,809	12,372,079	1,128,535,227	49,066,749	25.2%
06. 09	20	271,616,895	13,580,845	1,023,316,267	51,165,813	26.5%
06. 10	21	272,831,619	12,991,982	1,105,736,007	52,654,096	24.7%
06. 11	20	268,504,988	13,425,249	1,192,045,446	59,602,272	22.5%

(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ting後 決済比率
			一日平均		一日平均	
05. 05	18	119,019,609	6,612,201	367,863,615	20,436,868	32.4%
05. 06	22	176,772,778	8,035,126	618,845,391	28,129,336	28.6%
05. 07	20	165,683,947	8,284,197	628,105,781	31,405,289	26.4%
05. 08	23	214,161,566	9,311,372	842,592,241	36,634,445	25.4%
05. 09	20	210,769,654	10,538,483	816,064,570	40,803,229	25.8%
05. 10	20	205,457,290	10,272,865	856,910,894	42,845,545	24.0%
05. 11	20	193,684,320	9,684,216	847,825,759	42,391,288	22.8%
05. 12	21	214,869,117	10,231,863	864,860,196	41,183,819	24.8%
06. 01	19	179,961,482	9,471,657	752,740,021	39,617,896	23.9%
06. 02	20	189,704,733	9,485,237	846,403,053	42,320,153	22.4%
06. 03	22	264,018,608	12,000,846	1,117,666,656	50,803,030	23.6%
06. 04	20	269,416,836	13,470,842	1,151,797,344	57,589,867	23.4%
06. 05	20	314,468,119	15,723,406	1,390,272,077	69,513,604	22.6%
06. 06	22	356,210,530	16,191,388	1,482,167,155	67,371,234	24.0%
06. 07	20	299,160,718	14,958,036	1,233,081,538	61,654,077	24.3%
06. 08	23	283,769,233	12,337,793	1,122,352,851	48,797,950	25.3%
06. 09	20	272,639,403	13,631,970	1,026,999,060	51,349,953	26.5%
06. 10	21	272,789,907	12,989,996	1,105,592,089	52,647,242	24.7%
06. 11	20	269,100,833	13,455,042	1,194,287,564	59,714,378	22.5%

以上