

統計月報 平成17年8月

2005年9月30日
株式会社 日本国債清算機関

I 債務引受

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

(額面及び決済金額については単位:百万円)

【参考1】市場全体の取引高との比較

	2005年8月			過去2ヶ月の比率推移	
	債務引受高	市場取引高	比率	7月	6月
売買取引	140,698,370	263,086,800	53.5%	48.6%	49.2%
現先取引	14,449,556	334,981,600	4.3%	3.4%	2.4%
現先取引(エンドのみ)	0				
貸借取引	353,959,049	1,029,834,100	34.4%	29.7%	27.1%
貸借取引(エンドのみ)	118,594				

(債務引受高及び市場取引高については単位:百万円)

II 国債・資金決済

(1)DVP決済状況

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

(額面及び決済金額については単位:百万円)

【参考2】日本銀行におけるDVP決済全体との比較

	2005年8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	7月	6月
DVP決済件数(一日平均)	2,891	9,492	30.5%	27.7%	25.5%

(2)FOS決済状況

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

(決済金額については単位:百万円)

(3)時間帯別決済完了状況

	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	28,632	3,562	921	191	130	6.5
国債引渡	23,582	7,755	1,254	276	196	3.6
合計	52,214	11,317	2,175	467	326	
決済進捗率	78.3%	95.3%	98.6%	99.3%	99.8%	

(国債受取・引渡・合計は単位:件数、決済所要時間は単位:分)

(4)フェイル発生状況

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

(額面については単位:百万円)

Ⅲ ネットティング効果

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	
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%

(額面については単位: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	
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%

(決済金額については単位:百万円)

統計に関して

全般

単位未満は切り捨て、平均値は四捨五入としております。

I 債務引受

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】

市場取引高は日本証券業協会調べ

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金額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。

II 国債・資金決済

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、弊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。

弊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、弊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】

DVP決済件数は日本銀行調べ

Ⅲ ネットティング効果

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。

また、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。)

弊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。

以上