

# 統計月報 平成17年7月

2005年9月5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 |

(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7月     |             |       | 過去2ヶ月の比率推移 |       |
|-------------|-------------|-------------|-------|------------|-------|
|             | 債務引受高       | 市場取引高       | 比率    | 6月         | 5月    |
| 売買取引        | 97,060,034  | 199,620,800 | 48.6% | 49.2%      | 51.4% |
| 現先取引        | 9,897,764   | 289,527,900 | 3.4%  | 2.4%       | 2.7%  |
| 現先取引(エンドのみ) | 0           |             |       |            |       |
| 貸借取引        | 253,415,741 | 854,815,000 | 29.7% | 27.1%      | 23.1% |
| 貸借取引(エンドのみ) | 88,920      |             |       |            |       |

(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 |

(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7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    | 6月         | 5月    |
| DVP決済件数(一日平均) | 2,583   | 9,314  | 27.7% | 25.5%      | 22.4% |

### (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 |

(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  | 21,581 | 3,492   | 697     | 149     | 73    | 4.2    |
| 国債引渡  | 18,044 | 6,270   | 1,003   | 228     | 113   | 4.0    |
| 合計    | 39,625 | 9,762   | 1,700   | 377     | 186   |        |
| 決済進捗率 | 76.6%  | 95.5%   | 98.8%   | 99.5%   | 99.9% |        |

(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  |

(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<br>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%            |

(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<br>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%            |

(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