

統計月報 平成17年5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

(額面及び決済金額については単位:百万円)

(注) 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。
単位未満は切り捨て、平均値は四捨五入としております。

【参考1】市場全体の取引高との比較

	2005年5月 債務引受高	2005年5月		昨年度月間平均	
		市場取引高	比率	市場取引高	比率
売買取引	99,121,007	192,871,200	51.4%	237,419,800	41.7%
現先取引	6,820,040	255,040,700	2.7%	289,030,000	2.4%
現先取引(エンドのみ)	0				
貸借取引	171,449,440	742,979,500	23.1%	745,248,300	23.0%
貸借取引(エンドのみ)	267,964				

(債務引受高及び市場取引高については単位:百万円)

(注) 市場取引高は日本証券業協会調べ、昨年度の平均は2004年4月から2005年3月までの月間平均です。
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

(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

(額面及び決済金額については単位:百万円)

(注) 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。(但し、5月2日は含まず。)
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。
単位未満は切り捨て、平均値は四捨五入としております。

【参考2】日本銀行におけるDVP決済全体との比較

	2005年5月 弊社決済件数	2005年5月		昨年度月間平均	
		DVP決済件数	比率	DVP決済件数	比率
DVP決済件数(一日平均)	2,085	9,305	22.4%	9,489	22.0%

(注) DVP決済件数は日本銀行調べ、昨年度の平均は2004年4月から2005年3月までの月間平均です。

(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

(決済金額については単位:百万円)

(注) 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。
単位未満は切り捨て、平均値は四捨五入としております。

(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	14,814	2,825	742	281	223	2.2
国債引渡	12,050	4,724	1,056	448	360	3.5
合計	26,864	7,549	1,798	729	583	
決済進捗率	70.4%	90.2%	94.9%	96.8%	98.3%	

(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

(額面については単位:百万円)

(注) 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。
単位未満は切り捨て、平均値は四捨五入としております。

【参考3】業務開始後のフェイル発生額面及び件数の推移

	フェイル発生 額面		フェイル発生 件数		週末時点決済未了状況	
		一日平均		一日平均	額面	件数
5/6-5/13	145,690	24,282	75	12.5	67,450	40
5/16-5/20	147,340	29,468	52	10.4	69,800	24
5/23-5/27	80,480	16,096	22	4.4	13,980	4
5/30-6/3	45,400	9,080	14	2.8	0	0

(額面については単位:百万円)

Ⅲ ネットینگ効果

年月	決済日数	DVP決済高(額面)		債務引受高(額面)		ネットینگ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%

(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ینگ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%

(決済金額については単位:百万円)

(注) 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。
単位未満は切り捨て、平均値は四捨五入としております。

以上