統計データ

（国債店頭取引）

2018年2月

株式会社日本証券クリアリング機構

【目次】

➢債務引受け・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・1
➢国債・資金決済・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・1
➢ネッティング効果・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・3

【例言】

➢本統計データは、当社が行う国債店頭取引清算業務を対象としております。
➢掲載数値の単位未満は切捨て、平均値は四捨五入としております。（内訳とその合計が合致しない場合があります。）
●本統計データに係る表記方法は、次のとおりです。
「r」訂正値
「…」不詳・その他
※r については、次回公表時からは削除します。
➢債務引受けについて
● 債務引受けは、引受日を基準に、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。現金担保付債券貸借取引及び現先取引は、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、エンドのみ引受けの場合は、エンド取引のみ対象としております。なお、現先取引のサブスティテューションに係る当初現先取引の終了を目的とした取引は集計対象外としております。
●取引種類別債務引受高は、債務引受高（額面）について、売買、現金担保付債券貸借取引、現先取引別の内訳となります。通常債務引受けはスタート取引とエンド取引両方について債務引受けしたものとなります。エンドのみ債務引受けはエンド取引のみについて債務引受けしたものとなります。
➢国債・資金決済について
●DVP決済状況は、債務引受け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、当社の国債受取り及び引渡しの両方について、額面、金額、件数を合計しております。
● FOS決済状況は、決済日をベースに集計しております。当社の受取り及び支払の両方についての金額の合計です。
（FOS決済：変動証拠金等の資金のみ決済。）
● フェイル発生状況については、当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】における「日本銀行決済高」と「日本銀行決済件数」は、日本銀行調べです。
➢ ネッティング効果について
● 債務引受けは、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。
●現金担保付債券貸借取引及び現先取引は、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。
●エンドのみ引受けの場合は、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決済高（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。）当社の国債受取り及び引渡しの両方について額面及び金額を合計しております。

【注意事項】

➢原則として、本統計データは、翌月の第3営業日目頃に掲載します。
➢当社は、出所を明示する場合にのみ本統計データの転用・引用を認めます。商用目的で転載等を行う場合、予め当社までご連絡ください。
➢ 本統計データの情報の正確性については、万全を期していますが、当社は当該情報の利用者に対し、一切の責任を負いません。

【お問合せ先】

（株）日本証券クリアリング機構 国債店頭取引清算グループ
電話：03-5645-3810
e-mail：jgb-plan@jscc.co.jp

Ⅰ 債務引受け

1．債務引受け（額面、金額、件数）　　（単位：百万円、件）

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
2016	245	28,558,765,673	116,566,391	30,240,838,715	123,431,995	2,743,728	11,199
2017	247	30,956,300,700	125,329,153	32,229,215,561	130,482,654	3,041,104	12,312
2018	38	4,344,358,393	114,325,221	4,513,634,963	118,779,867	457,988	12,052
17. 02	20	2,587,923,276	129,396,164	2,685,857,140	134,292,857	234,226	11,711
17. 03	22	2,941,662,697	133,711,941	3,058,126,178	139,005,735	269,824	12,265
17. 04	20	2,895,189,562	144,759,478	3,022,137,378	151,106,869	262,244	13,112
17. 05	20	2,704,087,700	135,204,385	2,816,747,425	140,837,371	241,154	12,058
17. 06	22	2,823,419,278	128,337,240	2,942,651,186	133,756,872	281,904	12,814
17. 07	20	2,361,292,484	118,064,624	2,457,748,790	122,887,440	235,154	11,758
17. 08	22	2,656,112,860	120,732,403	2,765,783,375	125,717,426	248,198	11,282
17. 09	20	2,419,297,919	120,964,896	2,520,162,189	126,008,109	265,290	13,265
17. 10	21	2,485,872,147	118,374,864	2,591,299,936	123,395,235	271,360	12,922
17. 11	20	2,228,970,113	111,448,506	2,326,103,843	116,305,192	263,202	13,160
17. 12	21	2,476,772,847	117,941,564	2,568,400,169	122,304,770	242,944	11,569
18. 01	19	2,181,667,631	114,824,612	2,261,461,557	119,024,292	216,294	11,384
18. 02	19	2,162,690,762	113,825,830	2,252,173,405	118,535,442	241,694	12,721

2．取引種類別債務引受高（額面）　　（単位：百万円）

年月	売買	現金担保付債券貸借取引			現先取引		
		合計	通常債務引受け（スタート＋エンド）	エンドのみ債務引受け	合計	通常債務引受け（スタート＋エンド）	エンドのみ債務引受け
2016	1,262,640,895	26,160,291,497	26,048,198,751	112,092,746	1,135,833,280	1,122,913,200	12,920,080
2017	1,387,726,660	28,161,106,400	28,060,785,036	100,321,364	1,407,467,640	1,402,869,200	4,598,440
2018	210,324,777	3,904,102,816	3,880,943,157	23,159,659	229,930,800	229,358,400	572,400
17. 02	110,307,132	2,346,483,544	2,337,016,000	9,467,544	131,132,600	130,971,200	161,400
17. 03	125,316,438	2,674,244,258	2,667,874,996	6,369,262	142,102,000	141,179,200	922,800
17. 04	107,461,208	2,653,504,153	2,648,845,789	4,658,364	134,224,200	133,976,000	248,200
17. 05	95,439,004	2,466,307,496	2,452,945,728	13,361,768	142,341,200	142,308,000	33,200
17. 06	131,989,616	2,590,354,862	2,579,987,084	10,367,778	101,074,800	100,637,600	437,200
17. 07	99,953,152	2,171,868,732	2,165,329,684	6,539,048	89,470,600	89,410,800	59,800
17. 08	121,042,884	2,436,905,576	2,431,714,656	5,190,920	98,164,400	97,759,600	404,800
17. 09	124,950,311	2,188,321,208	2,172,317,436	16,003,772	106,026,400	105,848,400	178,000
17. 10	115,139,045	2,214,783,901	2,210,057,201	4,726,700	155,949,200	155,113,200	836,000
17. 11	126,429,242	2,024,102,231	2,017,218,301	6,883,930	78,438,640	78,059,600	379,040
17. 12	111,331,732	2,250,503,115	2,244,334,165	6,168,950	114,938,000	114,740,800	197,200
18. 01	97,822,785	1,962,512,646	1,955,976,493	6,536,153	121,332,200	121,199,600	132,600
18. 02	112,501,992	1,941,590,170	1,924,966,664	16,623,506	108,598,600	108,158,800	439,800

Ⅱ 国債・資金決済

1．DVP決済状況　　（単位：百万円、件）

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
2016	245	7,189,736,573	29,345,864	7,553,437,483	30,830,357	1,774,075	7,241
2017	247	7,459,277,913	30,199,506	7,760,365,692	31,418,485	1,855,115	7,511
2018	38	1,130,987,304	29,762,824	1,167,131,396	30,713,984	282,203	7,426
17. 02	20	564,562,452	28,228,123	590,513,866	29,525,693	140,239	7,012
17. 03	22	708,368,392	32,198,563	739,638,278	33,619,922	175,518	7,978
17. 04	20	688,012,403	34,400,620	719,734,851	35,986,743	169,467	8,473
17. 05	20	667,486,174	33,374,309	695,527,516	34,776,376	161,528	8,076
17. 06	22	732,194,530	33,281,570	759,317,769	34,514,444	178,510	8,114
17. 07	20	639,583,809	31,979,190	663,296,352	33,164,818	157,750	7,888
17. 08	22	623,633,246	28,346,966	646,205,812	29,372,991	154,776	7,035
17. 09	20	577,353,257	28,867,663	599,197,684	29,959,884	145,998	7,300
17. 10	21	558,560,047	26,598,098	581,640,348	27,697,159	143,955	6,855
17. 11	20	496,846,922	24,842,346	516,658,717	25,832,936	130,286	6,514
17. 12	21	640,379,451	30,494,260	661,699,124	31,509,482	160,417	7,639
18. 01	19	588,048,185	30,949,904	605,182,761	31,851,724	143,765	7,567
18. 02	19	542,939,119	28,575,743	561,948,634	29,576,244	138,438	7,286

【参考】日本銀行におけるDVP決済全体との比較　　（単位：百万円、件）

年月	決済日数	DVP決済高（額面、一日平均）			DVP決済件数（一日平均）		
		当社決済高	日本銀行決済高	比率	当社決済件数	日本銀行件数	比率
2016	245	29,345,864	53,779,031	54.6%	7,241	13,580	53.3%
2017	247	30,199,506	52,810,092	57.2%	7,511	13,394	56.1%
2018	19	30,949,904	54,394,979	56.9%	7,567	13,749	55.0%
17. 02	20	28,228,123	52,033,955	54.2%	7,012	13,080	53.6%
17. 03	22	32,198,563	58,080,732	55.4%	7,978	14,497	55.0%
17. 04	20	34,400,620	58,333,405	59.0%	8,473	14,591	58.1%
17. 05	20	33,374,309	57,565,305	58.0%	8,076	13,896	58.1%
17. 06	22	33,281,570	56,947,291	58.4%	8,114	14,009	57.9%
17. 07	20	31,979,190	53,975,640	59.2%	7,888	13,726	57.5%
17. 08	22	28,346,966	48,547,545	58.4%	7,035	12,459	56.5%
17. 09	20	28,867,663	50,209,270	57.5%	7,300	13,060	55.9%
17. 10	21	26,598,098	46,843,614	56.8%	6,855	12,439	55.1%
17. 11	20	24,842,346	45,230,160	54.9%	6,514	12,249	53.2%
17. 12	21	30,494,260	52,844,252	57.7%	7,639	13,661	55.9%
18. 01	19	30,949,904	54,394,979	56.9%	7,567	13,749	55.0%
18. 02	19	28,575,743	…	…	7,286	…	…

2. FOS決済状況　　（単位：百万円）

年月	決済日数	FOS決済　決済金額	
			一日平均
2016	245	11,657,281	47,581
2017	247	5,812,710	23,533
2018	38	696,512	18,329
17. 02	20	595,174	29,759
17. 03	22	587,495	26,704
17. 04	20	534,844	26,742
17. 05	20	479,282	23,964
17. 06	22	463,576	21,072
17. 07	20	476,068	23,803
17. 08	22	344,444	15,657
17. 09	20	633,187	31,659
17. 10	21	328,128	15,625
17. 11	20	461,549	23,077
17. 12	21	338,085	16,099
18. 01	19	347,491	18,289
18. 02	19	349,020	18,369

3. 時間帯別決済完了状況　　（単位：件、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	66,479	2,051	608	379	18	1.3
国債引渡	64,437	2,907	964	560	35	2.3
合計	130,916	4,958	1,572	939	53	
決済進捗率	94.5%	98.1%	99.3%	99.9%	100.0%	

4. フェイル発生状況　　（単位：百万円、件）

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
2016	245	1,280,513	5,227	338	1.4
2017	247	661,599	2,679	211	0.9
2018	38	146,433	3,854	39	1.0
17. 02	20	142,371	7,119	44	2.2
17. 03	22	54,998	2,500	14	0.6
17. 04	20	24,552	1,228	10	0.5
17. 05	20	8,058	403	3	0.2
17. 06	22	32,299	1,468	13	0.6
17. 07	20	28,900	1,445	13	0.7
17. 08	22	23,210	1,055	7	0.3
17. 09	20	69,748	3,487	27	1.4
17. 10	21	99,600	4,743	25	1.2
17. 11	20	90,523	4,526	26	1.3
17. 12	21	28,151	1,341	15	0.7
18. 01	19	86,233	4,539	24	1.3
18. 02	19	60,200	3,168	15	0.8

Ⅲ ネッティング効果

（単位：百万円）

年月	決済日数	DVP決済高（額面）		債務引受高（額面）		ﾈｯﾃｨﾝｸﾞ後
			一日平均		一日平均	決済比率
2016	245	7,189,832,173	29,346,254	28,495,600,913	116,308,575	25.2%
2017	247	7,459,234,713	30,199,331	30,952,163,248	125,312,402	24.1%
2018	38	1,130,987,304	29,762,824	4,355,156,233	114,609,375	26.0%
17. 02	20	564,783,159	28,239,158	2,538,215,513	126,910,776	22.3%
17. 03	22	708,147,685	32,188,531	2,924,921,892	132,950,995	24.2%
17. 04	20	688,012,403	34,400,620	2,937,713,955	146,885,698	23.4%
17. 05	20	667,486,174	33,374,309	2,689,974,284	134,498,714	24.8%
17. 06	22	732,194,530	33,281,570	2,828,164,338	128,552,924	25.9%
17. 07	20	639,583,809	31,979,190	2,394,798,204	119,739,910	26.7%
17. 08	22	623,670,446	28,348,657	2,613,243,301	118,783,786	23.9%
17. 09	20	577,316,057	28,865,803	2,429,479,901	121,473,995	23.8%
17. 10	21	558,569,247	26,598,536	2,514,040,116	119,716,196	22.2%
17. 11	20	496,945,322	24,847,266	2,226,916,094	111,345,805	22.3%
17. 12	21	640,271,851	30,489,136	2,483,647,145	118,268,912	25.8%
18. 01	19	588,048,185	30,949,904	2,184,042,544	114,949,608	26.9%
18. 02	19	542,939,119	28,575,743	2,171,113,689	114,269,142	25.0%

（単位：百万円）

年月	決済日数	DVP決済金額		債務引受金額		ﾈｯﾃｨﾝｸﾞ後
			一日平均		一日平均	決済比率
2016	245	7,553,535,985	30,830,759	30,175,839,562	123,166,692	25.0%
2017	247	7,760,320,171	31,418,300	32,225,027,532	130,465,699	24.1%
2018	38	1,167,131,396	30,713,984	4,523,194,457	119,031,433	25.8%
17. 02	20	590,741,120	29,537,056	2,636,259,935	131,812,997	22.4%
17. 03	22	739,411,024	33,609,592	3,039,343,082	138,151,958	24.3%
17. 04	20	719,734,851	35,986,743	3,064,275,705	153,213,785	23.5%
17. 05	20	695,527,516	34,776,376	2,803,015,541	140,150,777	24.8%
17. 06	22	759,317,769	34,514,444	2,947,720,363	133,987,289	25.8%
17. 07	20	663,296,352	33,164,818	2,493,088,064	124,654,403	26.6%
17. 08	22	646,249,532	29,374,979	2,720,716,764	123,668,944	23.8%
17. 09	20	599,153,964	29,957,698	2,531,881,366	126,594,068	23.7%
17. 10	21	581,649,953	27,697,617	2,621,637,711	124,839,891	22.2%
17. 11	20	516,757,711	25,837,886	2,323,404,023	116,170,201	22.2%
17. 12	21	661,590,525	31,504,311	2,576,294,847	122,680,707	25.7%
18. 01	19	605,182,761	31,851,724	2,263,028,729	119,106,775	26.7%
18. 02	19	561,948,634	29,576,244	2,260,165,727	118,956,091	24.9%