

統計データ

(国債店頭取引)

2018年5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……………3
- ネットイング効果……………6

【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」訂正值

「…」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。

銘柄先決め現先取引、銘柄後決め現先取引及び現金担保付債券貸借取引は、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、エンドのみ引受けの場合は、エンド取引のみ対象としております。

銘柄先決め現先取引のサブステイ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。

なお、銘柄後決め現先取引の債務引受額面については、債務引受金額と同額を集計しております。Unwind/Rewind債務引受金額は集計の対象外としております。

● 取引種別債務引受高及び取引種別債務引受金額は、債務引受高(額面)または債務引受金額について、4種類の取引(売買、銘柄先決め現先取引、銘柄後決め現先取引及び現金担保付債券貸借取引)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します。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します。銘柄後決め現先取引については、1回目から3回目までの各債務引受時点の内訳及び合計を集計しております。Unwind/Rewind債務引受金額は集計の対象外としております。取引種別債務引受金額は、2018年5月から集計しております。

➢ 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方について、額面、金額、件数を合計しております。

銘柄後決め現先取引については、1回目から3回目までの各決済の内訳及び合計を集計しております。

● 取引種別DVP決済状況は、債務引受けに係る決済について、売買・先決め現先(銘柄先決め現先取引)・現担(現金担保付債券貸借取引)及び銘柄後決め現先取引別の内訳となります。

【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。

● 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。

➢ ネットイング効果について

● 債務引受高(額面)及び債務引受金額は、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、金額を合計しております。

銘柄先決め現先取引及び現金担保付債券貸借取引は、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。

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。

銘柄後決め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金額を集計しております。

また、月内を決済日とするUnwind及びRewind債務引受金額を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5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:050-3361-1792

e-mail:jgb-plan@jpx.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		債務引受件数	
			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	100	10,648,605,063	106,486,051	11,089,116,988	110,891,170	1,192,920	11,929
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
18. 03	21	2,076,717,654	98,891,317	2,171,861,860	103,421,993	253,580	12,075
18. 04	20	2,046,813,201	102,340,660	2,139,766,180	106,988,309	244,538	12,227
18. 05	21	2,180,715,813	103,843,610	2,263,853,984	107,802,571	236,814	11,277

2. 取引種別債務引受高(額面)

(単位:百万円)

年月	売買	銘柄先決め現先取引			銘柄後決め現先取引			現金担保付債券貸借取引			
		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	1回目	2回目	3回目	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	1,135,833,280	1,122,913,200	12,920,080	-	-	-	26,160,291,497	26,048,198,751	112,092,746	
2017	1,387,726,660	1,407,467,640	1,402,869,200	4,598,440	-	-	-	28,161,106,400	28,060,785,036	100,321,364	
2018	531,937,681	940,626,526	928,631,524	11,995,002	430,693,747	315,658,191	86,022,820	29,012,735	8,745,347,107	8,690,429,176	54,917,931
17. 05	95,439,004	142,341,200	142,308,000	33,200	-	-	-	2,466,307,496	2,452,945,728	13,361,768	
17. 06	131,989,616	101,074,800	100,637,600	437,200	-	-	-	2,590,354,862	2,579,987,084	10,367,778	
17. 07	99,953,152	89,470,600	89,410,800	59,800	-	-	-	2,171,868,732	2,165,329,684	6,539,048	
17. 08	121,042,884	98,164,400	97,759,600	404,800	-	-	-	2,436,905,576	2,431,714,656	5,190,920	
17. 09	124,950,311	106,026,400	105,848,400	178,000	-	-	-	2,188,321,208	2,172,317,436	16,003,772	
17. 10	115,139,045	155,949,200	155,113,200	836,000	-	-	-	2,214,783,901	2,210,057,201	4,726,700	
17. 11	126,429,242	78,438,640	78,059,600	379,040	-	-	-	2,024,102,231	2,017,218,301	6,883,930	
17. 12	111,331,732	114,938,000	114,740,800	197,200	-	-	-	2,250,503,115	2,244,334,165	6,168,950	
18. 01	97,822,785	121,332,200	121,199,600	132,600	-	-	-	1,962,512,646	1,955,976,493	6,536,153	
18. 02	112,501,992	108,598,600	108,158,800	439,800	-	-	-	1,941,590,170	1,924,966,664	16,623,506	
18. 03	104,465,222	111,146,600	110,636,800	509,800	-	-	-	1,861,105,831	1,855,602,813	5,503,018	
18. 04	126,305,887	115,564,800	113,609,200	1,955,600	-	-	-	1,804,942,513	1,791,779,213	13,163,300	
18. 05	90,841,794	483,984,326	475,027,124	8,957,202	430,693,747	315,658,191	86,022,820	29,012,735	1,175,195,945	1,162,103,991	13,091,954

3. 取引種類別債務引受金額

(単位:百万円)

年月	売買	銘柄先決め現先取引			銘柄後決め現先取引				現金担保付債券貸借取引		
		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	1回目	2回目	3回目	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
2018	542,679,326	963,676,576	951,586,370	12,090,206	430,693,747	315,658,191	86,022,820	29,012,735	9,152,067,337	9,096,605,962	55,461,374
18. 01	99,483,091	125,259,835	125,124,283	135,551	-	-	-	-	2,036,718,630	2,030,158,048	6,560,582
18. 02	114,425,790	110,273,170	109,832,827	440,342	-	-	-	-	2,027,474,445	2,010,799,503	16,674,942
18. 03	106,627,109	113,087,816	112,576,449	511,366	-	-	-	-	1,952,146,933	1,946,616,861	5,530,071
18. 04	129,454,565	117,687,961	115,727,722	1,960,239	-	-	-	-	1,892,623,652	1,879,250,687	13,372,965
18. 05	92,688,768	497,367,792	488,325,087	9,042,705	430,693,747	315,658,191	86,022,820	29,012,735	1,243,103,675	1,229,780,862	13,322,813

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		DVP決済件数	
			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	100	2,718,921,618	27,189,216	2,819,814,798	28,198,148	719,824	7,198
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
18. 03	21	485,505,000	23,119,286	503,940,481	23,997,166	127,971	6,094
18. 04	20	504,741,352	25,237,068	525,952,271	26,297,614	129,842	6,492
18. 05	21	597,687,960	28,461,331	622,790,648	29,656,698	179,808	8,562

2. 取引種別DVP決済状況

(単位:百万円、件)

年月	DVP決済高(額面)					DVP決済金額					DVP決済件数				
	売買 先決め現先 現担	銘柄後決め現先取引				売買 先決め現先 現担	銘柄後決め現先取引				売買 先決め現先 現担	銘柄後決め現先取引			
		合計	1回目	2回目	3回目		合計	1回目	2回目	3回目		合計	1回目	2回目	3回目
2016	7,189,736,573	-	-	-	-	7,553,437,483	-	-	-	-	1,774,075	-	-	-	-
2017	7,459,277,913	-	-	-	-	7,760,365,692	-	-	-	-	1,855,115	-	-	-	-
2018	2,565,614,921	153,306,696	81,370,636	62,155,517	9,780,543	2,661,396,120	158,418,677	84,145,865	64,422,366	9,850,445	657,171	62,653	37,939	22,067	2,647
17. 05	667,486,174	-	-	-	-	695,527,516	-	-	-	-	161,528	-	-	-	-
17. 06	732,194,530	-	-	-	-	759,317,769	-	-	-	-	178,510	-	-	-	-
17. 07	639,583,809	-	-	-	-	663,296,352	-	-	-	-	157,750	-	-	-	-
17. 08	623,633,246	-	-	-	-	646,205,812	-	-	-	-	154,776	-	-	-	-
17. 09	577,353,257	-	-	-	-	599,197,684	-	-	-	-	145,998	-	-	-	-
17. 10	558,560,047	-	-	-	-	581,640,348	-	-	-	-	143,955	-	-	-	-
17. 11	496,846,922	-	-	-	-	516,658,717	-	-	-	-	130,286	-	-	-	-
17. 12	640,379,451	-	-	-	-	661,699,124	-	-	-	-	160,417	-	-	-	-
18. 01	588,048,185	-	-	-	-	605,182,761	-	-	-	-	143,765	-	-	-	-
18. 02	542,939,119	-	-	-	-	561,948,634	-	-	-	-	138,438	-	-	-	-
18. 03	485,505,000	-	-	-	-	503,940,481	-	-	-	-	127,971	-	-	-	-
18. 04	504,741,352	-	-	-	-	525,952,271	-	-	-	-	129,842	-	-	-	-
18. 05	444,381,263	153,306,696	81,370,636	62,155,517	9,780,543	464,371,971	158,418,677	84,145,865	64,422,366	9,850,445	117,155	62,653	37,939	22,067	2,647

【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	79	26,851,059	50,564,495	53.1%	6,836	13,060	52.3%
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	51,594,068	55.4%	7,286	13,467	54.1%
18. 03	21	23,119,286	47,222,000	49.0%	6,094	12,396	49.2%
18. 04	20	25,237,068	49,457,060	51.0%	6,492	12,714	51.1%
18. 05	21	28,461,331	8,562

3. 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	100	1,861,059	18,611
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
18. 03	21	400,779	19,085
18. 04	20	385,200	19,260
18. 05	21	378,567	18,027

4. 時間帯別決済完了状況

売買・銘柄先決め現先取引・現金担保付債券貸借取引

(単位:件、分)

	9:00~9:30	9:30~10:00	10:00~10:30	10:30~11:00	11:00~11:30	11:30~12:00	12:00~12:30	12:30~13:00	13:00~13:30	13:30~	決済所要時間
国債受取	50,490	3,705	2,695	837	614	236	134	219	20	2	1.4
国債引渡	44,083	5,296	4,729	1,723	1,104	475	316	423	41	13	2.3
合計	94,573	9,001	7,424	2,560	1,718	711	450	642	61	15	
決済進捗率	80.7%	88.4%	94.7%	96.9%	98.3%	99.0%	99.3%	99.9%	99.9%	100.0%	

銘柄後決め現先取引

(単位:件、分)

1回目	9:00~9:30	9:30~10:00	10:00~10:30	10:30~	決済所要時間
国債受取	18,709	429	452	0	1.8
国債引渡	16,975	736	580	58	2.5
合計	35,684	1,165	1,032	58	
決済進捗率	94.0%	97.1%	99.8%	100.0%	

2回目	11:00~11:30	11:30~12:00	12:00~12:30	12:30~13:00	13:00~13:30	13:30~	決済所要時間
国債受取	10,730	221	11	7	0	0	0.1
国債引渡	10,185	569	28	316	0	0	9.0
合計	20,915	790	39	323	0	0	
決済進捗率	94.8%	98.4%	98.5%	100.0%	100.0%	100.0%	

3回目	14:00~14:30	14:30~15:00	15:00~15:30	15:30~	決済所要時間
国債受取	1,242	45	0	0	0.1
国債引渡	1,271	89	0	0	4.8
合計	2,513	134	0	0	
決済進捗率	94.9%	100.0%	100.0%	100.0%	

5. 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	100	332,137	3,321	113	1.1
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
18. 03	21	74,557	3,550	25	1.2
18. 04	20	66,008	3,300	24	1.2
18. 05	21	45,139	2,149	25	1.2

Ⅲ ネットティング効果

売買・銘柄先決め現先取引・現金担保付債券貸借取引

(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ینگ後 決済比率	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	一日平均	一日平均		一日平均	一日平均			
2016	245	7,189,832,173	29,346,254	28,495,600,913	116,308,575	25.2%	7,553,535,985	30,830,759	30,175,839,562	123,166,692	25.0%
2017	247	7,459,234,713	30,199,331	30,952,163,248	125,312,402	24.1%	7,760,320,171	31,418,300	32,225,027,532	130,465,699	24.1%
2018	100	2,565,614,921	25,656,149	10,344,503,418	103,445,034	24.8%	2,661,396,120	26,613,961	10,789,439,833	107,894,398	24.7%
17. 05	20	667,486,174	33,374,309	2,689,974,284	134,498,714	24.8%	695,527,516	34,776,376	2,803,015,541	140,150,777	24.8%
17. 06	22	732,194,530	33,281,570	2,828,164,338	128,552,924	25.9%	759,317,769	34,514,444	2,947,720,363	133,987,289	25.8%
17. 07	20	639,583,809	31,979,190	2,394,798,204	119,739,910	26.7%	663,296,352	33,164,818	2,493,088,064	124,654,403	26.6%
17. 08	22	623,670,446	28,348,657	2,613,243,301	118,783,786	23.9%	646,249,532	29,374,979	2,720,716,764	123,668,944	23.8%
17. 09	20	577,316,057	28,865,803	2,429,479,901	121,473,995	23.8%	599,153,964	29,957,698	2,531,881,366	126,594,068	23.7%
17. 10	21	558,569,247	26,598,536	2,514,040,116	119,716,196	22.2%	581,649,953	27,697,617	2,621,637,711	124,839,891	22.2%
17. 11	20	496,945,322	24,847,266	2,226,916,094	111,345,805	22.3%	516,757,711	25,837,886	2,323,404,023	116,170,201	22.2%
17. 12	21	640,271,851	30,489,136	2,483,647,145	118,268,912	25.8%	661,590,525	31,504,311	2,576,294,847	122,680,707	25.7%
18. 01	19	588,048,185	30,949,904	2,184,042,544	114,949,608	26.9%	605,182,761	31,851,724	2,263,028,729	119,106,775	26.7%
18. 02	19	542,939,119	28,575,743	2,171,113,689	114,269,142	25.0%	561,948,634	29,576,244	2,260,165,727	118,956,091	24.9%
18. 03	21	485,505,000	23,119,286	2,071,472,783	98,641,561	23.4%	503,940,481	23,997,166	2,167,720,246	103,224,774	23.2%
18. 04	20	504,741,352	25,237,068	2,121,940,950	106,097,048	23.8%	525,952,271	26,297,614	2,217,947,676	110,897,384	23.7%
18. 05	21	444,381,263	21,161,013	1,795,933,450	85,520,641	24.7%	464,371,971	22,112,951	1,880,577,453	89,551,307	24.7%

銘柄後決め現先取引

(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効果算出用)		ネットینگ後 決済比率
		一日平均	一日平均	一日平均	一日平均	
2016	245	-	-	-	-	-
2017	247	-	-	-	-	-
2018	100	158,418,677	1,584,187	749,024,695	35,667,843	21.1%
17. 05	20	-	-	-	-	-
17. 06	22	-	-	-	-	-
17. 07	20	-	-	-	-	-
17. 08	22	-	-	-	-	-
17. 09	20	-	-	-	-	-
17. 10	21	-	-	-	-	-
17. 11	20	-	-	-	-	-
17. 12	21	-	-	-	-	-
18. 01	19	-	-	-	-	-
18. 02	19	-	-	-	-	-
18. 03	21	-	-	-	-	-
18. 04	20	-	-	-	-	-
18. 05	21	158,418,677	7,543,747	749,024,695	35,667,843	21.1%