

月次統計データ(金利スワップ)

2012/12

1. 債務負担件数・金額

6M-Libor(vs Fixed)

(単位:件、百万円)

年月	0-2Y		2-5Y		5-10Y		10-30Y		30+Y	
	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額
2012/10	173	4,727,060	380	3,906,930	774	4,330,260	263	772,030	0	0
2012/11	251	9,244,950	592	5,941,620	1,244	7,097,705	560	2,111,810	3	5,015
2012/12	350	10,449,750	606	6,083,170	1,507	8,951,205	650	2,087,600	3	7,000

3M-Libor(vs Fixed)

(単位:件、百万円)

年月	0-2Y		2-5Y		5-10Y		10-30Y		30+Y	
	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額
2012/10	3	40,000	0	0	8	50,000	0	0	0	0
2012/11	21	1,241,000	1	10,000	10	59,100	1	5,000	0	0
2012/12	8	466,000	1	10,000	24	270,640	1	3,000	0	0

6M-Libor vs 3M-Libor(basis)

(単位:件、百万円)

年月	0-2Y		2-5Y		5-10Y		10-30Y		30+Y	
	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額	債務負担件数	債務負担金額
2012/10	12	270,420	19	247,480	8	27,700	5	15,140	0	0
2012/11	8	331,560	41	378,140	25	129,630	29	68,310	0	0
2012/12	16	934,700	25	440,390	43	264,450	12	49,610	0	0

2. 債務負担総件数・残高

6M-Libor(vs Fixed)

(単位:件、百万円)

年月	0-2Y		2-5Y		5-10Y		10-30Y		30+Y	
	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高
2012/10	173	4,577,060	380	3,906,930	774	4,318,460	263	772,030	0	0
2012/11	424	13,822,010	972	9,848,550	2,018	11,416,165	823	2,883,840	3	5,015
2012/12	774	24,271,760	1,578	15,931,720	3,525	20,356,770	1,473	4,956,940	6	12,015

3M-Libor(vs Fixed)

(単位:件、百万円)

年月	0-2Y		2-5Y		5-10Y		10-30Y		30+Y	
	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高
2012/10	3	40,000	0	0	8	50,000	0	0	0	0
2012/11	24	1,281,000	1	10,000	18	109,100	1	5,000	0	0
2012/12	32	1,747,000	2	20,000	42	379,740	2	8,000	0	0

6M-Libor vs 3M-Libor(basis)

(単位:件、百万円)

年月	0-2Y		2-5Y		5-10Y		10-30Y		30+Y	
	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高	債務負担総件数	債務負担残高
2012/10	12	270,420	19	247,480	8	27,700	5	15,140	0	0
2012/11	20	601,980	60	605,620	33	152,330	34	83,450	0	0
2012/12	36	1,536,680	85	1,046,010	76	416,780	46	133,060	0	0

【注意事項】

- 債務負担金額は想定元本ベースとなっております。
- 債務負担件数、債務負担金額及び債務負担残高は全て片道ベースとなっております。
- 債務負担残高は、当日の15:30時点における債務負担残高です(デクリアされた取引及び満期を迎えた取引を除く)。
- 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、万全を期しておりますが、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 OTCデリバティブ業務推進室
 電話：03-3665-1405
 e-mail：otc@jscc.co.jp