

月次統計データ(金利スワップ)

2012/11

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 |

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 |

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 |

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 |

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 |

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 |

【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。
- 債務負担総件数、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