

月次統計データ(金利スワップ)

2012/10

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

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

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

2. 債務負担残高

6M-Libor(vs Fixed)

(単位:百万円)

年月	0-2Y	2-5Y	5-10Y	10-30Y	30+Y
2012/10	4,577,060	3,906,930	4,318,460	772,030	0

3M-Libor(vs Fixed)

(単位:百万円)

年月	0-2Y	2-5Y	5-10Y	10-30Y	30+Y
2012/10	40,000	0	50,000	0	0

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

(単位:百万円)

年月	0-2Y	2-5Y	5-10Y	10-30Y	30+Y
2012/10	270,420	247,480	27,700	15,140	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。
- 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