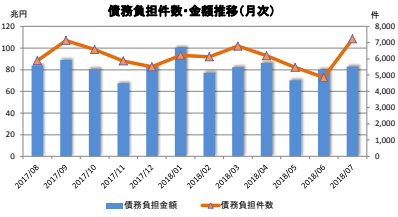


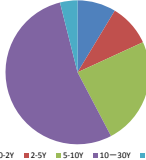
月次統計データ(金利スワップ)

2018/07

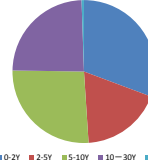
債務負担件数・金額



債務負担件数(テナー別)



債務負担金額(テナー別)



<合計>

年/月	合計		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	債務負担件数	債務負担金額
2017/08	5,892	83,847,922	632	32,699,695	624	10,145,650	1,720	20,957,328	2,712	19,686,308	204	358,940
2017/09	7,135	88,889,299	937	35,192,611	849	13,842,500	2,085	22,237,892	3,092	17,288,787	172	327,510
2017/10	6,576	80,612,346	738	27,503,678	706	13,281,973	1,803	21,929,198	3,047	17,336,257	282	561,250
2017/11	5,870	67,405,241	493	17,613,695	614	10,616,039	1,810	22,598,074	2,772	16,195,410	181	380,042
2017/12	5,509	82,404,900	585	24,230,135	729	17,748,400	1,633	22,769,435	2,446	17,395,104	116	261,825
2018/01	6,223	100,107,826	769	38,560,540	664	17,940,660	1,978	26,254,204	2,698	17,449,653	114	202,768
2018/02	6,123	77,080,068	691	27,329,008	698	14,767,846	1,755	20,156,981	2,824	14,479,023	155	347,210
2018/03	6,784	82,245,163	600	29,012,819	815	16,645,500	1,796	19,227,289	3,378	16,905,416	195	454,139
2018/04	6,193	96,165,856	866	37,838,805	560	13,016,093	1,551	18,926,615	3,035	16,026,430	161	358,013
2018/05	5,474	70,166,754	815	30,519,876	580	13,145,237	1,252	13,264,666	2,732	13,101,901	95	135,086
2018/06	4,853	79,902,629	848	44,254,729	462	10,147,941	1,126	12,882,528	2,273	12,336,583	144	280,847
2018/07	7,233	82,883,107	626	25,435,239	686	15,150,370	1,748	21,776,975	3,889	20,067,234	284	453,289

<内訳>

【JPY】

vs Fixed

LIBOR

年/月	合計		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	債務負担件数	債務負担金額
2017/08	5,136	67,032,986	505	22,376,205	468	7,995,244	1,480	17,999,870	2,501	18,306,227	202	358,440
2017/09	6,144	75,534,140	820	28,123,320	672	11,919,395	1,728	19,626,728	2,764	15,554,687	160	310,010
2017/10	5,840	70,509,573	616	22,203,289	576	11,365,442	1,616	20,061,502	2,868	16,330,560	273	547,750
2017/11	5,388	60,489,853	446	15,488,978	517	9,164,924	1,504	19,855,738	2,643	15,615,670	178	364,542
2017/12	4,972	70,784,009	500	20,284,320	573	13,519,570	1,462	20,403,872	2,322	16,319,421	115	256,825
2018/01	5,758	90,453,764	709	35,283,730	570	15,349,900	1,849	24,027,764	2,516	15,589,602	114	202,768
2018/02	5,589	67,309,897	632	22,834,620	589	12,199,561	1,541	18,052,164	2,673	13,877,343	154	346,210
2018/03	5,725	66,124,207	513	24,144,760	601	11,732,054	1,436	14,909,945	2,996	14,922,528	179	414,919
2018/04	5,586	76,776,320	796	34,707,115	455	9,902,359	1,363	16,958,072	2,797	14,866,261	173	344,513
2018/05	4,898	59,959,421	715	25,477,556	456	10,689,928	1,056	11,591,055	2,531	12,068,797	93	131,086
2018/06	4,244	72,547,172	794	42,250,409	348	8,663,491	941	10,479,638	2,029	10,899,237	132	254,397
2018/07	6,632	74,837,970	583	23,919,333	591	13,521,290	1,559	18,778,200	3,625	18,204,553	274	414,589

ユーロ円TIBOR (ZTIBOR)

年/月	合計		0-2Y		2-5Y		5-10Y		10-20Y	
	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
2017/08	32	623,560	6	250,000	2	16,000	16	263,700	8	91,860
2017/09	53	693,000	8	280,000	7	56,500	23	264,500	15	73,200
2017/10	28	480,683	4	150,000	3	130,000	6	61,040	12	139,643
2017/11	17	704,238	6	517,000	1	10,000	6	163,388	4	13,850
2017/12	46	820,900	9	205,000	13	270,000	16	238,000	8	107,900
2018/01	23	593,700	1	50,000	4	67,000	6	124,000	12	352,700
2018/02	32	380,000	1	60,000	1	2,000	25	281,000	5	47,000
2018/03	88	2,431,000	14	1,307,000	36	666,000	27	373,000	11	85,000
2018/04	88	490,000	9	165,000	8	60,000	9	96,000	62	169,000
2018/05	37	494,100	8	149,000	1	2,000	16	245,900	12	97,200
2018/06	47	651,500	5	60,000	3	45,000	18	274,000	21	272,500
2018/07	44	425,289	3	55,000	3	20,000	2	32,000	36	318,289

OIS

年/月	合計		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	債務負担件数	債務負担金額
2017/08	38	2,971,550	15	2,240,780	1	50,000	7	84,760	14	43,010	1	3,000
2017/09	42	427,100	4	295,000	1	1,400	8	66,600	29	64,100	0	0
2017/10	71	1,071,935	15	876,900	6	62,500	13	50,450	29	79,685	2	2,500
2017/11	42	604,410	7	380,560	6	102,000	6	35,000	23	85,350	1	1,500
2017/12	28	374,030	7	150,000	6	180,000	0	0	0	44,030	0	0
2018/01	26	1,733,001	15	1,650,000	0	0	1	2,000	10	41,001	0	0
2018/02	69	3,072,540	22	2,696,450	6	258,900	7	46,000	31	70,190	1	1,000
2018/03	100	546,100	1	50,000	7	96,500	24	203,330	64	187,270	4	9,000
2018/04	74	1,311,780	13	1,033,000	4	40,000	20	110,530	35	125,750	2	2,500
2018/05	71	2,647,680	16	2,155,270	8	256,400	15	116,350	30	115,660	2	4,000
2018/06	39	520,580	6	310,000	6	112,700	5	43,300	19	50,500	3	4,080
2018/07	50	817,670	13	579,780	3	30,000	9	98,940	25	108,950	0	0

日本円TIBOR (DTIBOR)

年/月	合計		0-2Y		2-5Y		5-10Y	
	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
2017/08	93	408,914	8	90,300	54	243,126	31	75,488
2017/09	144	264,919	34	110,921	59	125,185	51	28,714
2017/10	86	134,926	34	71,188	36	46,441	16	17,297
2017/11	49	212,491	3	37	24	106,115	22	106,339
2017/12	62	462,908	4	50,015	35	402,150	23	10,743
2018/01	27	256,841	16	250,130	7	3,200	4	3,511
2018/02	24	68,760	5	61,528	6	315	13	6,917
2018/03	71	39,779	4	99	24	23,555	43	16,124
2018/04	41	24,297	1	100	15	4,464	25	19,713
2018/05	41	37,639	0	0	22	9,058	19	28,581
2018/06	48	17,810	1	10	20	4,540	27	13,260
2018/07	34	38,916	3	20,020	12	7,440	19	11,456

Basis Swap

LIBOR

(単位: 件、百万円)

Table with columns: Year/Month, Total, 0-2Y, 2-5Y, 5-10Y, 10-30Y, 30+Y. Each column contains 'Debt Outstanding' and 'Debt to Retire'.

※6M-LIBOR vs 3M-LIBOR, 6M-LIBOR vs 1M-LIBOR及び3M-LIBOR vs 1M-LIBORが対象

ユーロ円TIBOR (ZTIBOR)

(単位: 件、百万円)

Table with columns: Year/Month, Total, 0-2Y, 2-5Y, 5-10Y, 10-20Y. Each column contains 'Debt Outstanding' and 'Debt to Retire'.

※6M-ZTIBOR vs 3M-ZTIBOR, 6M-ZTIBOR vs 1M-ZTIBOR及び3M-ZTIBOR vs 1M-ZTIBORが対象

日本円TIBOR (DTIBOR)

(単位: 件、百万円)

Table with columns: Year/Month, Total, 0-2Y, 2-5Y, 5-10Y. Each column contains 'Debt Outstanding' and 'Debt to Retire'.

※6M-DTIBOR vs 3M-DTIBOR, 6M-DTIBOR vs 1M-DTIBOR及び3M-DTIBOR vs 1M-DTIBORが対象

LIBOR vs ユーロ円TIBOR (ZTIBOR)

(単位: 件、百万円)

Table with columns: Year/Month, Total, 0-2Y, 2-5Y, 5-10Y, 10-20Y. Each column contains 'Debt Outstanding' and 'Debt to Retire'.

※6M-LIBOR vs 6M-ZTIBOR, 6M-LIBOR vs 3M-ZTIBOR, 6M-LIBOR vs 1M-ZTIBOR, 3M-LIBOR vs 6M-ZTIBOR, 3M-LIBOR vs 3M-ZTIBOR, 3M-LIBOR vs 1M-ZTIBOR, 1M-LIBOR vs 6M-ZTIBOR, 1M-LIBOR vs 3M-ZTIBOR及び1M-LIBOR vs 1M-ZTIBORが対象

LIBOR vs 日本円TIBOR (DTIBOR)

(単位: 件、百万円)

Table with columns: Year/Month, Total, 0-2Y, 2-5Y, 5-10Y. Each column contains 'Debt Outstanding' and 'Debt to Retire'.

※6M-LIBOR vs 6M-DTIBOR, 6M-LIBOR vs 3M-DTIBOR, 6M-LIBOR vs 1M-DTIBOR, 3M-LIBOR vs 6M-DTIBOR, 3M-LIBOR vs 3M-DTIBOR, 3M-LIBOR vs 1M-DTIBOR, 1M-LIBOR vs 6M-DTIBOR, 1M-LIBOR vs 3M-DTIBOR及び1M-LIBOR vs 1M-DTIBORが対象

ユーロ円TIBOR (ZTIBOR) vs 日本円TIBOR (DTIBOR)

(単位: 件、百万円)

Table with columns: Year/Month, Total, 0-2Y, 2-5Y, 5-10Y. Each column contains 'Debt Outstanding' and 'Debt to Retire'.

※6M-ZTIBOR vs 6M-DTIBOR, 6M-ZTIBOR vs 3M-DTIBOR, 6M-ZTIBOR vs 1M-DTIBOR, 3M-ZTIBOR vs 6M-DTIBOR, 3M-ZTIBOR vs 3M-DTIBOR, 3M-ZTIBOR vs 1M-DTIBOR, 1M-ZTIBOR vs 6M-DTIBOR, 1M-ZTIBOR vs 3M-DTIBOR及び1M-ZTIBOR vs 1M-DTIBORが対象

[USD]

vs Fixed

LIBOR

(単位: 件、百万円)

Table with columns: Year/Month, Total, 0-2Y, 2-5Y, 5-10Y, 10-30Y. Each column contains 'Debt Outstanding' and 'Debt to Retire'.

【注意事項】

- 借付金額は期元本ベースです。
○債務負担総額・金額及び借付総額・残存引取額・債務負担総額高はすべて円換算した金額です。
○借付総額・金額及び借付総額高の合計金額のうち、外資IRS分は当日の15:00時点における為替レートにより円換算した金額です。
○借付総額・金額・引取額については、取引コンプレッションや一括コンプレッション等のポストクレンジング処理によって新たに生成された取引は対象外です。
○借付総額・金額・残存引取額・債務負担総額高は、当日の15:00時点における借付総額・残存引取額・債務負担総額高です。なお、円換算ベースであるため、ポストクレンジング処理により件数が生じる可能性があります。
○当社は、出納を明示する場合にかぎってデータエラーの監視・利用を拒否します。商目自体が記載等を行う場合、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、当社に当該情報の利用者に對し、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子リポジティブ決済グループ
電話: 050-3361-1794
e-mail: otc@jcb.co.jp