

公社債投資家別条件付売買（現先）月末残高

<統計の目的>

広く一般の皆様には公社債の取引の状況を御理解いただく指標の一つとして、公社債の条件付売買（現先）の状況について、売買の主体である投資家別に区分し、残高を公表しています。

<用語の定義>

「債券等の条件付売買（現先）取引」とは、売買の目的たる債券等と同種、同量（発行体、発行回号、種類、券面額、数量及び課税条件が同一）の債券等を将来の所定期日（所定の方法により決定される期日を含む。）に所定の価額（所定の計算方法により算出される価額を含む。）で買い戻すこと又は売り戻すことを内容とする特約付の債券等の売買をいいます。

<作成方法>

協会員からの毎月末の公社債投資家別条件付売買（現先）の残高の報告を基に、集計しています。

※特別会員については、登録金融機関業務にかかる取扱いについてのみ報告を求めています。

<利用上の注意>

- ・ 売買残高は各投資家を主体に集計しています。
- ・ 「債券ディーラー」に区分される売買残高は会員（証券会社）及び特別会員（登録金融機関業務に係る取扱いのみ）の売買残高です。
- ・ 当初個別契約で定められた受渡日を基準として集計しています。
- ・ 個別契約上、月末日において、取引実行日（スタート日）が到来し、取引決済日（エンド日）が未到来の取引を売買残高として集計しています。
- ・ 取引対象債券等の差替え（サブスティチューション）等の取引は集計対象外です。
- ・ スタート取引に係る受渡・決済のフェイルは、月末残高として集計し、エンド取引に係る受渡・決済のフェイルは、集計対象外です。

- ・債務不履行が生じ、個別契約が解除された取引は集計対象外です。
- ・協会員が、日本銀行の国債現先オペ（新現先方式による国債条件付売買）を落札した場合や財務省財政融資資金の現先オペを落札した場合は、「その他」に計上しています。

<公表時期>

原則として毎月20日に、本協会のホームページにて公表いたします。

<お問い合わせ先>

市場企画部 市場統計室 (TEL:03-3667-8483)

この解説資料は、本協会が提供している統計情報を一般の皆様が利用するに当たり、統計情報に用いられている用語等について理解を進めるための一助として分かりやすく説明したものであり、必ずしも法令・諸規則等における定義等に基づくものではありません。