

債券貸借取引残高等状況

<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こと指標の一つとして、公社債の貸借取引の状況について、売買の主体である投資家別に区分し公表しております。

<用語の定義>

- ・「債券貸借取引」とは、当事者の一方（貸出者）が、他方（借入者）に債券を貸出し、当事者間で合意された期間を経た後、借入者が貸出者に当該銘柄と同種、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）の債券を返済する債券の消費貸借取引をいいます。
- ・「有担保取引」とは、取引担保金（現金及び代用有価証券等）を差し入れ（又は受け入れ）ている取引をいいます。
- ・「現金担保取引」とは、有担保取引のうち、取引担保金をすべて現金で差し入れ（又は受け入れ）ている取引をいいます。
- ・「無担保取引」とは、取引担保金の差し入れ（又は受け入れ）を行っていない取引をいいます。
- ・「全体取引」とは、有担保取引（現金担保取引を含む）及び無担保取引の合計をいいます。
- ・「翌日物」とは、約定時において貸借期間を1営業日と定めた取引をいいます。
- ・「オープンエンド」とは、約定時において取引決済日を定めない取引をいいます。
- ・「その他」とは、上記以外の取引をいいます。

<作成方法>

協会員からの本店、支店、およびその他の営業所における、売買の主体である投資家別の債券貸借取引の状況についての報告を基に、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>

- ・月末取引残高については、当初個別契約で定められた受渡日を基準に、協会員が貸し付けた（又は借り入れた）公社債券の月末時点の残高を集計しています。

また、個別契約上、月末日において、取引実行日が到来し、取引決済日が未到来の取引についても残高を集計しています。

- ・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ていますが、エンド取引に係る受渡・決済のフェイルは、集計対象外としています。
- また、債務不履行が生じ、個別契約が解除された取引についても集計対象外としています。

- ・月中新規成約高については、約定ベースで額面により集計しています。

<公表時期>

原則として毎月 25 日に、協会ホームページにて公表いたします。

<お問い合わせ先>

公社債・金融商品部市場統計業務室（TEL：03-6665-6774）

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。