

平成28年1月27日更新

(2) 金利関連取引

1. 通貨別残高(クロスカレンシー取引を除く)

上段：想定元本(兆円)
下段：契約件数(件)

| | 円建 | ドル建 | ユーロ建 | ポンド建 | その他通貨建 | 総計 |
|--------------|-----------|----------|---------|---------|----------|-----------|
| 銀行等計 | 505.7 | 211.9 | 29.8 | 8.9 | 20.8 | 777.0 |
| | (153,970) | (30,890) | (5,305) | (2,045) | (9,204) | (201,414) |
| 大手行等 | 472.2 | 207.7 | 29.4 | 8.8 | 20.5 | 738.5 |
| | (122,531) | (29,546) | (5,147) | (2,021) | (7,938) | (167,183) |
| 地域銀行 | 19.0 | 1.1 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 20.2 |
| | (27,370) | (748) | (68) | (4) | (48) | (28,238) |
| 外国銀行支店その他銀行 | 14.6 | 3.1 | 0.3 | 0.1 | 0.2 | 18.3 |
| | (4,069) | (596) | (90) | (20) | (1,218) | (5,993) |
| 第一種金融商品取引業者計 | 332.8 | 23.9 | 2.4 | 0.4 | 11.1 | 370.7 |
| | (60,748) | (5,062) | (614) | (105) | (3,310) | (69,839) |
| 日本証券クリアリング機構 | 2,287.4 | - | - | - | - | 2,287.4 |
| | (222,082) | - | - | - | - | (222,082) |
| 上記計 | 3,125.9 | 235.8 | 32.2 | 9.3 | 31.9 | 3,435.1 |
| | (436,800) | (35,952) | (5,919) | (2,150) | (12,514) | (493,335) |

(注1) 銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、日本証券クリアリング機構から報告される取引は、含まれない。

(注2) 銀行等及び第一種金融商品取引業者から報告される非清算店頭デリバティブ取引については、同一の取引であっても双方から報告されるものは、重複して計上している。

(注3) 大手行等には、主要行等、商工組合中央金庫、日本政策投資銀行、信金中央金庫及び農林中央金庫が含まれている。

(注4) 日本証券クリアリング機構から報告される取引については、債務引受の相手方双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注5) 今後集計方法の変更や報告情報の精査を行った場合には変動し得る。

(2) 金利関連取引

2. 通貨別残高(クロスカレンシー取引分)

上段：想定元本(兆円)
下段：契約件数(件)

| | 円建 | ドル建 | ユーロ建 | ポンド建 | その他通貨建 | 総計 |
|--------------|----------|----------|---------|-------|---------|----------|
| 銀行等計 | 99.8 | 117.7 | 9.4 | 2.6 | 23.0 | 252.5 |
| | (19,702) | (25,004) | (1,792) | (234) | (7,936) | (54,668) |
| 大手行等 | 80.4 | 101.5 | 6.5 | 2.6 | 21.7 | 212.6 |
| | (14,210) | (20,373) | (1,183) | (224) | (7,482) | (43,472) |
| 地域銀行 | 6.9 | 6.6 | 0.2 | 0.0 | 0.1 | 13.9 |
| | (3,508) | (3,332) | (127) | (0) | (105) | (7,072) |
| 外国銀行支店その他銀行 | 12.5 | 9.6 | 2.7 | 0.1 | 1.2 | 26.1 |
| | (1,984) | (1,299) | (482) | (10) | (349) | (4,124) |
| 第一種金融商品取引業者計 | 27.9 | 31.3 | 1.6 | 0.3 | 5.2 | 66.3 |
| | (6,460) | (6,886) | (687) | (187) | (1,550) | (15,770) |
| 日本証券クリアリング機構 | - | - | - | - | - | - |
| | - | - | - | - | - | - |
| 上記計 | 127.6 | 149.0 | 11.1 | 2.9 | 28.2 | 318.8 |
| | (26,162) | (31,890) | (2,479) | (421) | (9,486) | (70,438) |

(注1) 銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、日本証券クリアリング機構から報告される取引は、含まれない。

(注2) 銀行等及び第一種金融商品取引業者から報告される非清算店頭デリバティブ取引については、同一の取引であっても双方から報告されるものは、重複して計上している。

(注3) 大手行等には、主要行等、商工組合中央金庫、日本政策投資銀行、信金中央金庫及び農林中央金庫が含まれている。

(注4) 日本証券クリアリング機構から報告される取引については、債務引受の相手方双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注5) クロスカレンシー金利スワップ取引の各残高については、基本的に一つの取引に二つの通貨が参照されているため、参照される通貨に応じて重複して計上している。

(注6) 今後集計方法の変更や報告情報の精査を行った場合には変更し得る。

(2) 金利関連取引

3. 残存期間別残高(クロスカレンシー取引を除く)

上段： 想定元本(兆円)
下段： 契約件数(件)

| | ～3ヶ月 | 3～6ヶ月 | 6～12ヶ月 | 1年～2年 | 2年～5年 | 5年～10年 | 10年～30年 | 30年超 | 総計 |
|--------------|----------|----------|----------|----------|-----------|-----------|----------|-------|-----------|
| 銀行等計 | 41.3 | 40.5 | 71.4 | 133.1 | 273.5 | 164.4 | 52.7 | 0.2 | 777.0 |
| | (7,954) | (8,240) | (15,496) | (29,059) | (72,165) | (49,281) | (19,024) | (195) | (201,414) |
| 大手行等 | 38.4 | 39.1 | 69.1 | 128.5 | 261.6 | 154.6 | 47.0 | 0.2 | 738.5 |
| | (6,647) | (6,947) | (13,095) | (24,507) | (59,045) | (40,735) | (16,162) | (45) | (167,183) |
| 地域銀行 | 1.1 | 1.0 | 1.3 | 2.6 | 7.3 | 5.1 | 1.7 | - | 20.2 |
| | (1,132) | (1,182) | (2,179) | (4,076) | (11,831) | (6,632) | (1,206) | - | (28,238) |
| 外国銀行支店その他銀行 | 1.8 | 0.4 | 0.9 | 2.0 | 4.6 | 4.6 | 3.9 | 0.0 | 18.3 |
| | (175) | (111) | (222) | (476) | (1,289) | (1,914) | (1,656) | (150) | (5,993) |
| 第一種金融商品取引業者計 | 15.6 | 15.8 | 26.2 | 49.1 | 101.7 | 101.5 | 60.6 | 0.3 | 370.7 |
| | (1,584) | (1,691) | (2,945) | (6,209) | (16,590) | (19,579) | (21,028) | (213) | (69,839) |
| 日本証券クリアリング機構 | 136.9 | 107.9 | 222.7 | 249.7 | 652.5 | 796.6 | 120.9 | 0.1 | 2,287.4 |
| | (4,052) | (3,345) | (8,113) | (12,009) | (55,277) | (99,436) | (39,736) | (114) | (222,082) |
| 上記計 | 193.7 | 164.2 | 320.3 | 431.9 | 1,027.7 | 1,062.5 | 234.1 | 0.6 | 3,435.1 |
| | (13,590) | (13,276) | (26,554) | (47,277) | (144,032) | (168,296) | (79,788) | (522) | (493,335) |

(注1) 銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、日本証券クリアリング機構から報告される取引は、含まれない。

(注2) 銀行等及び第一種金融商品取引業者から報告される非清算店頭デリバティブ取引については、同一の取引であっても双方から報告されるものは、重複して計上している。

(注3) 大手行等には、主要行等、商工組合中央金庫、日本政策投資銀行、信金中央金庫及び農林中央金庫が含まれている。

(注4) 日本証券クリアリング機構から報告される取引については、債務引受の相手方双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注5) 今後集計方法の変更や報告情報の精査を行った場合には変更し得る。

(2) 金利関連取引

4. 残存期間別残高(クロスカレンシー取引分)

上段：想定元本(兆円)
下段：契約件数(件)

| | ～3ヶ月 | 3～6ヶ月 | 6～12ヶ月 | 1年～2年 | 2年～5年 | 5年～10年 | 10年～30年 | 30年超 | 総計 |
|--------------|---------|---------|---------|---------|----------|---------|---------|------|----------|
| 銀行等計 | 8.6 | 9.4 | 17.3 | 27.7 | 43.0 | 15.4 | 4.9 | - | 126.3 |
| | (1,835) | (2,134) | (3,721) | (5,970) | (9,950) | (2,906) | (818) | - | (27,334) |
| 大手行等 | 7.1 | 8.1 | 14.5 | 23.4 | 36.0 | 12.9 | 4.4 | - | 106.3 |
| | (1,422) | (1,661) | (2,983) | (4,783) | (7,529) | (2,569) | (789) | - | (21,736) |
| 地域銀行 | 0.6 | 0.6 | 1.0 | 1.2 | 3.0 | 0.5 | 0.0 | - | 6.9 |
| | (249) | (310) | (494) | (662) | (1,642) | (177) | (2) | - | (3,536) |
| 外国銀行支店その他銀行 | 0.9 | 0.8 | 1.8 | 3.1 | 4.0 | 1.9 | 0.5 | - | 13.0 |
| | (164) | (163) | (244) | (525) | (779) | (160) | (27) | - | (2,062) |
| 第一種金融商品取引業者計 | 2.3 | 2.0 | 3.6 | 5.8 | 9.7 | 6.7 | 2.9 | 0.0 | 33.1 |
| | (289) | (309) | (523) | (1,165) | (2,189) | (2,332) | (1,067) | (11) | (7,885) |
| 日本証券クリアリング機構 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 上記計 | 10.9 | 11.4 | 20.9 | 33.5 | 52.7 | 22.1 | 7.9 | 0.0 | 159.4 |
| | (2,124) | (2,443) | (4,244) | (7,135) | (12,139) | (5,238) | (1,885) | (11) | (35,219) |

(注1) 銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、日本証券クリアリング機構から報告される取引は、含まれない。

(注2) 銀行等及び第一種金融商品取引業者から報告される非清算店頭デリバティブ取引については、同一の取引であっても双方から報告されるものは、重複して計上している。

(注3) 大手行等には、主要行等、商工組合中央金庫、日本政策投資銀行、信金中央金庫及び農林中央金庫が含まれている。

(注4) 日本証券クリアリング機構から報告される取引については、債務引受の相手方双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注5) 今後集計方法の変更や報告情報の精査を行った場合には変更し得る。

(2) 金利関連取引

5. 商品別残高(クロスカレンシー取引を除く)

上段 : 想定元本(兆円)
下段 : 契約件数(件)

| | 固定-変動 | 変動-変動 | OIS | スワップション | その他 | 総計 |
|--------------|-----------|----------|-------|----------|----------|-----------|
| 銀行等計 | 664.4 | 49.8 | 0.9 | 34.1 | 27.9 | 777.0 |
| | (174,555) | (6,298) | (74) | (8,591) | (11,896) | (201,414) |
| 大手行等 | 633.0 | 48.3 | 0.7 | 33.7 | 22.8 | 738.5 |
| | (145,006) | (5,778) | (56) | (7,868) | (8,475) | (167,183) |
| 地域銀行 | 16.1 | 1.2 | 0.2 | 0.3 | 2.4 | 20.2 |
| | (24,783) | (484) | (18) | (536) | (2,417) | (28,238) |
| 外国銀行支店その他銀行 | 15.2 | 0.2 | - | 0.2 | 2.7 | 18.3 |
| | (4,766) | (36) | - | (187) | (1,004) | (5,993) |
| 第一種金融商品取引業者計 | 247.2 | 31.9 | 2.7 | 79.1 | 9.8 | 370.7 |
| | (47,973) | (4,654) | (256) | (11,568) | (5,388) | (69,839) |
| 日本証券クリアリング機構 | 2,038.2 | 247.8 | 1.4 | - | - | 2,287.4 |
| | (203,458) | (18,456) | (168) | - | - | (222,082) |
| 上記計 | 2,949.8 | 329.5 | 4.9 | 113.2 | 37.7 | 3,435.1 |
| | (425,986) | (29,408) | (498) | (20,159) | (17,284) | (493,335) |

(注1) 銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、日本証券クリアリング機構から報告される取引は、含まれない。

(注2) 銀行等及び第一種金融商品取引業者から報告される非清算店頭デリバティブ取引については、同一の取引であっても双方から報告されるものは、重複して計上している。

(注3) 大手行等には、主要行等、商工組合中央金庫、日本政策投資銀行、信金中央金庫及び農林中央金庫が含まれている。

(注4) 日本証券クリアリング機構から報告される取引については、債務引受の相手方双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注5) 「固定-変動」とは固定金利と変動金利を交換する金利スワップのことを指し、「変動-変動」とは変動金利同士を交換する金利スワップを指す。「OIS」とは、Overnight Index Swapの略で、一般に翌日物金利を参照する金利スワップのことを指す。「FRA」とは、Forward Rate Agreementの略で、一般に金利先渡取引のことを指す。「スワップション」とは、一般にスワップ取引を行う権利を原資産とするオプション取引のことを指す。

(注6) 今後集計方法の変更や報告情報の精査を行った場合には変更し得る。

(2) 金利関連取引

6. 商品別残高(クロスカレンシー取引分)

上段：想定元本(兆円)
下段：契約件数(件)

| | 固定-変動 | 固定-固定 | 変動-変動 | 総計 |
|--------------|---------|----------|----------|----------|
| 銀行等計 | 22.9 | 26.2 | 77.1 | 126.3 |
| | (7,229) | (10,609) | (9,496) | (27,334) |
| 大手行等 | 20.9 | 13.3 | 72.1 | 106.3 |
| | (6,755) | (6,309) | (8,672) | (21,736) |
| 地域銀行 | 0.2 | 5.4 | 1.3 | 6.9 |
| | (148) | (3,014) | (374) | (3,536) |
| 外国銀行支店その他銀行 | 1.9 | 7.5 | 3.6 | 13.0 |
| | (326) | (1,286) | (450) | (2,062) |
| 第一種金融商品取引業者計 | 2.8 | 4.5 | 25.8 | 33.1 |
| | (667) | (2,496) | (4,722) | (7,885) |
| 日本証券クリアリング機構 | - | - | - | - |
| | - | - | - | - |
| 上記計 | 25.8 | 30.7 | 102.9 | 159.4 |
| | (7,896) | (13,105) | (14,218) | (35,219) |

(注1) 銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、日本証券クリアリング機構から報告される取引は、含まれない。

(注2) 銀行等及び第一種金融商品取引業者から報告される非清算店頭デリバティブ取引については、同一の取引であっても双方から報告されるものは、重複して計上している。

(注3) 大手行等には、主要行等、商工組合中央金庫、日本政策投資銀行、信金中央金庫及び農林中央金庫が含まれている。

(注4) 日本証券クリアリング機構から報告される取引については、債務引受の相手方双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注5) 「固定-変動」とは固定金利と変動金利を交換する金利スワップのことを指し、「固定-固定」とは固定金利同士を、「変動-変動」とは変動金利同士を交換する金利スワップのことを指す。

(注6) 今後集計方法の変更や報告情報の精査を行った場合には変更し得る。

(2) 金利関連取引

7. 参照金利別残高(クロスカレンシー取引を除く)

〔 上段 : 想定元本(兆円)
下段 : 契約件数(件) 〕

| | LIBOR | TIBOR | EURIBOR | その他 | 総計 |
|--------------|-----------|----------|---------|----------|-----------|
| 銀行等計 | 649.2 | 106.4 | 28.9 | 31.3 | 815.8 |
| | (118,942) | (60,496) | (5,091) | (16,213) | (200,742) |
| 大手行等 | 620.9 | 99.9 | 28.7 | 30.6 | 780.1 |
| | (102,703) | (44,689) | (4,963) | (14,789) | (167,144) |
| 地域銀行 | 13.3 | 6.2 | 0.1 | 0.3 | 19.9 |
| | (12,079) | (15,632) | (60) | (165) | (27,936) |
| 外国銀行支店その他銀行 | 15.0 | 0.4 | 0.1 | 0.4 | 15.9 |
| | (4,160) | (175) | (68) | (1,259) | (5,662) |
| 第一種金融商品取引業者計 | 347.8 | 31.0 | 2.5 | 14.6 | 395.8 |
| | (61,854) | (3,931) | (606) | (3,934) | (70,325) |
| 日本証券クリアリング機構 | 2,321.1 | 212.6 | - | 1.4 | 2,535.1 |
| | (228,263) | (12,107) | - | (168) | (240,538) |
| 上記計 | 3,318.1 | 350.1 | 31.3 | 47.3 | 3,746.8 |
| | (409,059) | (76,534) | (5,697) | (20,315) | (511,605) |

(注1) 銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、日本証券クリアリング機構から報告される取引は、含まれない。

(注2) 銀行等及び第一種金融商品取引業者から報告される非清算店頭デリバティブ取引については、同一の取引であっても双方から報告されるものは、重複して計上している。

(注3) 大手行等には、主要行等、商工組合中央金庫、日本政策投資銀行、信金中央金庫及び農林中央金庫が含まれている。

(注4) 日本証券クリアリング機構から報告される取引については、債務引受の相手方双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注5) 取引対象である金利の双方又は一方が変動金利を参照している取引を計上。変動金利同士を交換するスワップ取引(ベシススワップ等)の各残高については、基本的に一つの取引につき二つの変動金利を参照しているため、参照する金利に応じて重複して計上している。

(注6) 今後集計方法の変更や報告情報の精査を行った場合には変更し得る。

(2) 金利関連取引

8. 参照金利別残高(クロスカレンシー取引分)

〔 上段 : 想定元本(兆円)
下段 : 契約件数(件) 〕

| | LIBOR | TIBOR | EURIBOR | その他 | 総計 |
|--------------|----------|-------|---------|---------|----------|
| 銀行等計 | 168.2 | 0.1 | 3.9 | 8.2 | 180.3 |
| | (23,593) | (101) | (727) | (1,800) | (26,221) |
| 大手行等 | 156.8 | 0.1 | 3.7 | 7.8 | 168.4 |
| | (21,878) | (101) | (683) | (1,565) | (24,227) |
| 地域銀行 | 2.7 | - | 0.1 | 0.0 | 2.8 |
| | (799) | - | (21) | (9) | (829) |
| 外国銀行支店その他銀行 | 8.7 | - | 0.1 | 0.3 | 9.1 |
| | (916) | - | (23) | (226) | (1,165) |
| 第一種金融商品取引業者計 | 53.1 | 0.0 | 1.0 | 3.9 | 58.0 |
| | (9,047) | (4) | (242) | (818) | (10,111) |
| 日本証券クリアリング機構 | - | - | - | - | - |
| | - | - | - | - | - |
| 上記計 | 221.3 | 0.1 | 4.8 | 12.0 | 238.3 |
| | (32,640) | (105) | (969) | (2,618) | (36,332) |

(注1) 銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、日本証券クリアリング機構から報告される取引は、含まれない。

(注2) 銀行等及び第一種金融商品取引業者から報告される非清算店頭デリバティブ取引については、同一の取引であっても双方から報告されるものは、重複して計上している。

(注3) 大手行等には、主要行等、商工組合中央金庫、日本政策投資銀行、信金中央金庫及び農林中央金庫が含まれている。

(注4) 日本証券クリアリング機構から報告される取引については、債務引受の相手方双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注5) 取引対象である金利の双方又は一方が変動金利を参照している取引を計上。変動金利同士を交換するスワップ取引(ベーススワップ等)の各残高については、基本的に一つの取引につき二つの変動金利を参照しているため、参照する金利に応じて重複して計上している。

(注6) 今後集計方法の変更や報告情報の精査を行った場合には変更し得る。