

## (2) 金利関連取引

平成28年1月27日更新

## 1. 通貨別残高(クロスカレンシー取引を除く)

(単位:兆円、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	875.9	195.9	34.1	9.0	22.9	1,137.8
	(194,774)	(31,644)	(5,573)	(2,032)	(10,338)	(244,361)
大手行等	840.6	192.0	33.7	8.9	22.6	1,097.8
	(163,680)	(30,461)	(5,409)	(2,013)	(9,406)	(210,969)
地域銀行	19.2	1.1	0.1	0.0	0.0	20.3
	(27,064)	(718)	(66)	(4)	(49)	(27,901)
外国銀行支店その他銀行	16.2	2.8	0.4	0.1	0.2	19.6
	(4,030)	(465)	(98)	(15)	(883)	(5,491)
第一種金融商品取引業者計	410.9	31.5	3.0	0.4	11.5	457.2
	(66,263)	(4,506)	(666)	(111)	(2,982)	(74,528)
日本証券クリアリング機構	1,902.2	-	-	-	-	1,902.2
	(180,568)	-	-	-	-	(180,568)
上記計	3,189.1	227.4	37.1	9.4	34.4	3,497.2
	(441,605)	(36,150)	(6,239)	(2,143)	(13,320)	(499,457)

(注1) 表中の計数は、平成26年9月末時点において、金商業者等及び日本証券クリアリング機構から報告を受けている店頭デリバティブ取引の残高(上段の計数、想定元本ベース)及び契約件数(下段括弧内の計数)であり、取引当事者双方から報告を受けた場合は二重に計上している。

(注2) 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3) 金融商品取引法156条の62の規定に基づき、清算集中義務の対象となっている取引は、日本証券クリアリング機構が報告主体となっており、表中の銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、清算集中義務の対象となっている取引は含まれない。

(注4) 表中の計数は、上記を前提として暫定的に集計した結果を公表するものであり、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)

(単位:兆円、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	96.9	111.6	10.4	2.4	20.3	241.6
	(20,383)	(25,806)	(2,005)	(242)	(8,204)	(56,640)
大手行等	77.6	95.4	7.1	2.3	19.2	201.6
	(14,370)	(20,701)	(1,313)	(223)	(7,789)	(44,396)
地域銀行	6.1	5.8	0.2	0.0	0.1	12.3
	(3,801)	(3,622)	(139)	(5)	(89)	(7,656)
外国銀行支店その他銀行	13.2	10.3	3.1	0.0	1.0	27.6
	(2,212)	(1,483)	(553)	(14)	(326)	(4,588)
第一種金融商品取引業者計	28.1	31.7	1.6	0.3	4.8	66.6
	(6,336)	(6,632)	(768)	(183)	(1,445)	(15,364)
日本証券クリアリング機構	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
上記計	125.0	143.3	12.1	2.6	25.1	308.1
	(26,719)	(32,438)	(2,773)	(425)	(9,649)	(72,004)

(注1) 表中の計数は、平成26年9月末時点において、金商業者等及び日本証券クリアリング機構から報告を受けている店頭デリバティブ取引の残高(上段の計数、想定元本ベース)及び契約件数(下段括弧内の計数)であり、取引当事者双方から報告を受けた場合は二重に計上している。

(注2) 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3) 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二重に計上している。

(注4) 金融商品取引法156条の62の規定に基づき、清算集中義務の対象となっている取引は、日本証券クリアリング機構が報告主体となっており、表中の銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、清算集中義務の対象となっている取引は含まれない。

(注5) 表中の計数は、上記を前提として暫定的に集計した結果を公表するものであり、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

## 3. 残存期間別残高(クロスカレンシー取引を除く)

(単位:兆円、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	52.0	45.7	99.1	166.2	399.9	309.1	65.4	0.3	1,137.8
	(8,816)	(8,757)	(17,324)	(32,843)	(86,986)	(66,093)	(23,341)	(201)	(244,361)
大手行等	47.8	44.6	96.0	161.6	388.3	299.6	59.7	0.2	1,097.8
	(7,541)	(7,471)	(14,739)	(28,190)	(74,275)	(57,841)	(20,871)	(41)	(210,969)
地域銀行	0.9	0.7	2.1	2.4	7.6	5.1	1.6	-	20.3
	(1,146)	(1,155)	(2,314)	(4,203)	(11,466)	(6,510)	(1,107)	-	(27,901)
外国銀行支店その他銀行	3.4	0.5	1.0	2.2	3.9	4.4	4.1	0.1	19.6
	(129)	(131)	(271)	(450)	(1,245)	(1,742)	(1,363)	(160)	(5,491)
第一種金融商品取引業者計	20.0	18.3	35.0	74.8	124.2	120.0	64.5	0.3	457.2
	(1,689)	(1,570)	(3,480)	(6,546)	(18,125)	(21,954)	(20,955)	(209)	(74,528)
日本証券クリアリング機構	98.3	100.0	213.9	222.7	498.9	673.4	95.0	0.1	1,902.2
	(2,772)	(2,624)	(6,125)	(9,867)	(41,519)	(87,633)	(29,980)	(48)	(180,568)
上記計	170.3	164.0	348.0	463.7	1,023.0	1,102.6	224.9	0.7	3,497.2
	(13,277)	(12,951)	(26,929)	(49,256)	(146,630)	(175,680)	(74,276)	(458)	(499,457)

(注1) 表中の計数は、平成26年9月末時点において、金商業者等及び日本証券クリアリング機構から報告を受けている店頭デリバティブ取引の残高(上段の計数、想定元本ベース)及び契約件数(下段括弧内の計数)であり、取引当事者双方から報告を受けた場合は二重に計上している。

(注2) 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3) 金融商品取引法156条の62の規定に基づき、清算集中義務の対象となっている取引は、日本証券クリアリング機構が報告主体となっており、表中の銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、清算集中義務の対象となっている取引は含まれない。

(注4) 表中の計数は、上記を前提として暫定的に集計した結果を公表するものであり、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

## 4. 残存期間別残高(クロスカレンシー取引分)

(単位:兆円、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	10.9	11.4	16.6	22.1	43.0	12.0	4.9	-	120.8
	(2,282)	(2,327)	(3,800)	(5,883)	(10,446)	(2,539)	(1,043)	-	(28,320)
大手行等	9.7	9.4	14.0	18.0	35.0	10.5	4.2	-	100.8
	(1,733)	(1,692)	(2,955)	(4,552)	(7,979)	(2,275)	(1,012)	-	(22,198)
地域銀行	0.7	0.6	0.8	1.2	2.4	0.5	0.0	-	6.1
	(415)	(400)	(528)	(822)	(1,511)	(150)	(2)	-	(3,828)
外国銀行支店その他銀行	0.5	1.3	1.8	2.9	5.6	1.1	0.7	-	13.8
	(134)	(235)	(317)	(509)	(956)	(114)	(29)	-	(2,294)
第一種金融商品取引業者計	1.9	2.6	4.3	5.2	10.6	5.9	2.8	0.0	33.3
	(298)	(296)	(574)	(1,014)	(2,337)	(2,119)	(1,033)	(11)	(7,682)
日本証券クリアリング機構	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上記計	12.8	14.0	20.9	27.3	53.6	17.9	7.6	0.0	154.1
	(2,580)	(2,623)	(4,374)	(6,897)	(12,783)	(4,658)	(2,076)	(11)	(36,002)

(注1) 表中の計数は、平成26年9月末時点において、金商業者等及び日本証券クリアリング機構から報告を受けている店頭デリバティブ取引の残高(上段の計数、想定元本ベース)及び契約件数(下段括弧内の計数)であり、取引当事者双方から報告を受けた場合は二重に計上している。

(注2) 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3) 金融商品取引法156条の62の規定に基づき、清算集中義務の対象となっている取引は、日本証券クリアリング機構が報告主体となっており、表中の銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、清算集中義務の対象となっている取引は含まれない。

(注4) 表中の計数は、上記を前提として暫定的に集計した結果を公表するものであり、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

## 5. 商品別残高(クロスカレンシー取引を除く)

(単位:兆円、件)

	固定-変動	変動-変動	OIS	FRA	スワップション	その他	総計
銀行等計	994.9	75.6	0.9	-	34.7	31.7	1,137.8
	(213,043)	(8,824)	(68)	-	(8,359)	(14,067)	(244,361)
大手行等	963.6	74.5	0.7	-	34.3	24.7	1,097.8
	(184,404)	(8,317)	(50)	-	(7,674)	(10,524)	(210,969)
地域銀行	16.5	1.0	0.2	-	0.3	2.4	20.3
	(24,311)	(471)	(18)	-	(530)	(2,571)	(27,901)
外国銀行支店その他銀行	14.8	0.2	-	-	0.1	4.6	19.6
	(4,328)	(36)	-	-	(155)	(972)	(5,491)
第一種金融商品取引業者計	319.0	36.8	4.6	-	86.4	10.3	457.2
	(54,052)	(4,942)	(277)	-	(10,632)	(4,625)	(74,528)
日本証券クリアリング機構	1,695.2	207.0	-	-	-	-	1,902.2
	(167,352)	(13,216)	-	-	-	-	(180,568)
上記計	3,009.1	319.5	5.5	-	121.1	42.0	3,497.2
	(434,447)	(26,982)	(345)	-	(18,991)	(18,692)	(499,457)

(注1) 表中の計数は、平成26年9月末時点において、金商業者等及び日本証券クリアリング機構から報告を受けている店頭デリバティブ取引の残高(上段の計数、想定元本ベース)及び契約件数(下段括弧内の計数)であり、取引当事者双方から報告を受けた場合は二重に計上している。

(注2) 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3) 「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4) 金融商品取引法156条の62の規定に基づき、清算集中義務の対象となっている取引は、日本証券クリアリング機構が報告主体となっており、表中の銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、清算集中義務の対象となっている取引は含まれない。

(注5) 表中の計数は、上記を前提として暫定的に集計した結果を公表するものであり、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

## 6. 商品別残高(クロスカレンシー取引分)

(単位:兆円、件)

	固定-変動	固定-固定	変動-変動	総計
銀行等計	19.1	27.9	73.8	120.8
	(6,957)	(11,509)	(9,854)	(28,320)
大手行等	16.9	15.8	68.2	100.8
	(6,461)	(6,702)	(9,035)	(22,198)
地域銀行	0.2	5.0	0.9	6.1
	(139)	(3,373)	(316)	(3,828)
外国銀行支店その他銀行	2.1	7.1	4.7	13.8
	(357)	(1,434)	(503)	(2,294)
第一種金融商品取引業者計	2.8	3.9	26.6	33.3
	(664)	(2,227)	(4,791)	(7,682)
日本証券クリアリング機構	-	-	-	-
	-	-	-	-
上記計	21.9	31.7	100.4	154.1
	(7,621)	(13,736)	(14,645)	(36,002)

(注1) 表中の計数は、平成26年9月末時点において、金商業者等及び日本証券クリアリング機構から報告を受けている店頭デリバティブ取引の残高(上段の計数、想定元本ベース)及び契約件数(下段括弧内の計数)であり、取引当事者双方から報告を受けた場合は二重に計上している。

(注2) 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3) 「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4) 金融商品取引法156条の62の規定に基づき、清算集中義務の対象となっている取引は、日本証券クリアリング機構が報告主体となっており、表中の銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、清算集中義務の対象となっている取引は含まれない。

(注5) 表中の計数は、上記を前提として暫定的に集計した結果を公表するものであり、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

## 7. 参照金利別残高(クロスカレンシー取引を除く)

(単位:兆円、件)

	LIBOR	TIBOR	EURIBOR	その他	総計
銀行等計	994.3	135.1	33.1	36.2	1,198.8
	(158,316)	(61,223)	(5,256)	(19,814)	(244,609)
大手行等	966.2	129.2	33.0	35.6	1,163.9
	(142,267)	(45,789)	(5,123)	(18,713)	(211,892)
地域銀行	13.9	5.5	0.1	0.3	19.8
	(12,099)	(15,233)	(59)	(181)	(27,572)
外国銀行支店その他銀行	14.2	0.4	0.1	0.3	15.1
	(3,950)	(201)	(74)	(920)	(5,145)
第一種金融商品取引業者計	422.1	33.9	3.0	27.7	486.7
	(67,518)	(3,963)	(660)	(3,600)	(75,741)
日本証券クリアリング機構	1,923.9	185.4	-	-	2,109.3
	(185,449)	(8,335)	-	-	(193,784)
上記計	3,340.3	354.4	36.2	63.9	3,794.8
	(411,283)	(73,521)	(5,916)	(23,414)	(514,134)

(注1) 表中の計数は、平成26年9月末時点において、金商業者等及び日本証券クリアリング機構から報告を受けている店頭デリバティブ取引の残高(上段の計数、想定元本ベース)及び契約件数(下段括弧内の計数)であり、取引当事者双方から報告を受けた場合は二重に計上している。

(注2) 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3) 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二重に計上している。

(注4) 金融商品取引法156条の62の規定に基づき、清算集中義務の対象となっている取引は、日本証券クリアリング機構が報告主体となっており、表中の銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、清算集中義務の対象となっている取引は含まれない。

(注5) 表中の計数は、上記を前提として暫定的に集計した結果を公表するものであり、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

## 8. 参照金利別残高(クロスカレンシー取引分)

(単位:兆円、件)

	LIBOR	TIBOR	EURIBOR	その他	総計
銀行等計	155.6	0.1	4.7	8.5	168.9
	(23,120)	(110)	(825)	(2,695)	(26,750)
	大手行等				
	143.1	0.1	4.4	8.1	155.7
	(21,356)	(81)	(767)	(2,516)	(24,720)
	地域銀行				
	1.9	0.0	0.1	0.0	2.0
	(683)	(29)	(24)	(5)	(741)
外国銀行支店その他銀行					
10.6	-	0.2	0.3	11.1	
(1,081)	-	(34)	(174)	(1,289)	
第一種金融商品取引業者計					
52.7	-	1.0	3.8	57.5	
(9,231)	-	(245)	(768)	(10,244)	
日本証券クリアリング機構					
-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	
上記計					
208.3	0.1	5.7	12.3	226.4	
(32,351)	(110)	(1,070)	(3,463)	(36,994)	

(注1) 表中の計数は、平成26年9月末時点において、金商業者等及び日本証券クリアリング機構から報告を受けている店頭デリバティブ取引の残高(上段の計数、想定元本ベース)及び契約件数(下段括弧内の計数)であり、取引当事者双方から報告を受けた場合は二重に計上している。

(注2) 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3) 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二重に計上している。

(注4) 金融商品取引法156条の62の規定に基づき、清算集中義務の対象となっている取引は、日本証券クリアリング機構が報告主体となっており、表中の銀行等及び第一種金融商品取引業者の報告残高には、清算集中義務の対象となっている取引は含まれない。

(注5) 表中の計数は、上記を前提として暫定的に集計した結果を公表するものであり、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。