

## 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	豪ドル建	その他通貨建	総計
銀行等	183.2	77.3	7.8	4.1	5.4	7.9	285.8
	(93,480)	(15,036)	(1,998)	(1,010)	(2,412)	(4,026)	(117,962)
大手行等	162.0	69.6	7.3	3.9	5.1	7.6	255.6
	(64,990)	(12,878)	(1,820)	(961)	(1,650)	(3,846)	(86,145)
地域銀行	10.9	1.7	0.1	0.0	0.0	0.0	12.8
	(24,492)	(1,126)	(63)	(7)	(46)	(5)	(25,739)
外国銀行支店その他銀行	10.2	6.0	0.4	0.2	0.3	0.3	17.4
	(3,998)	(1,032)	(115)	(42)	(716)	(175)	(6,078)
第一種金融商品取引業者	171.1	32.8	33.6	2.0	4.2	22.8	266.4
	(41,564)	(5,253)	(2,516)	(554)	(1,713)	(8,208)	(59,808)
保険会社	4.8	0.6	0.3	0.0	0.1	0.0	5.8
	(549)	(48)	(43)	(6)	(49)	(0)	(695)
清算機関	2,616.4	413.9	235.7	120.7	73.8	109.2	3569.8
	(270,819)	(40,001)	(12,793)	(14,042)	(7,982)	(29,353)	(374,990)
上記計	2,975.5	524.6	277.4	126.9	83.6	139.9	4,127.8
	(406,412)	(60,338)	(17,350)	(15,612)	(12,156)	(41,587)	(553,455)

(注1) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社の残高には、清算機関が債務引受を行った取引の残高は含まれない。

(注2) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社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) 清算機関の残高は、清算機関が国内の銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社から債務引受を行った取引の残高を記載している。

(注5) 清算機関から報告される取引については、債務引受の相手方が双方とも店頭デリバティブ取引報告の対象者である場合は双方分が報告されているため、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

### (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) 〕

	円ードル	円ーユーロ	円ーポンド	円ー豪ドル	ドルーユーロ	その他	総計
銀行等	89.4	9.4	1.5	2.6	12.5	28.4	143.8
	(15,980)	(1,172)	(177)	(647)	(1,335)	(9,967)	(29,278)
大手行等	71.8	6.0	1.4	1.4	12.5	27.9	121.0
	(11,722)	(765)	(153)	(406)	(1,327)	(9,636)	(24,009)
地域銀行	8.2	0.2	0.0	0.0	0.0	0.2	8.5
	(3,448)	(78)	(4)	(8)	(1)	(190)	(3,729)
外国銀行支店その他銀行	9.4	3.3	0.1	1.1	0.0	0.4	14.3
	(810)	(329)	(20)	(233)	(7)	(141)	(1,540)
第一種金融商品取引業者	41.8	2.3	0.2	2.2	7.0	22.4	75.8
	(8,163)	(484)	(72)	(820)	(826)	(6,467)	(16,832)
保険会社	4.0	0.8	0.3	0.5	0.0	0.5	6.2
	(755)	(406)	(251)	(321)	(14)	(612)	(2,359)
清算機関	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-
上記計	135.3	12.5	2.0	5.2	19.5	51.3	225.8
	(24,898)	(2,062)	(500)	(1,788)	(2,175)	(17,046)	(48,469)

(注1) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社の残高には、清算機関が債務引受を行った取引の残高は含まれない。

(注2) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社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) 清算機関の残高は、清算機関が国内の銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社から債務引受を行った取引の残高を記載している。

(注5) 清算機関から報告される取引については、債務引受の相手方が双方とも店頭デリバティブ取引報告の対象者である場合は双方分が報告されているため、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) 〕

	～1年	1年～5年	5年～	総計
銀行等	47.4	135.8	102.6	285.8
	(18,245)	(57,429)	(42,288)	(117,962)
大手行等	44.2	122.8	88.6	255.6
	(13,568)	(41,516)	(31,061)	(86,145)
地域銀行	1.9	5.8	5.1	12.8
	(4,048)	(13,695)	(7,996)	(25,739)
外国銀行支店その他銀行	1.3	7.2	8.9	17.4
	(629)	(2,218)	(3,231)	(6,078)
第一種金融商品取引業者	33.9	103.9	128.5	266.4
	(6,303)	(19,432)	(34,073)	(59,808)
保険会社	0.2	1.7	4.0	5.8
	(34)	(173)	(488)	(695)
清算機関	930.6	1,388.5	1,250.7	3,569.8
	(41,263)	(126,087)	(207,640)	(374,990)
上記計	1,012.2	1,629.9	1,485.8	4,127.8
	(65,845)	(203,121)	(284,489)	(553,455)

(注1) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社の残高には、清算機関が債務引受を行った取引の残高は含まれない。

(注2) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社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) 清算機関の残高は、清算機関が国内の銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社から債務引受を行った取引の残高を記載している。

(注5) 清算機関から報告される取引については、債務引受の相手方が双方とも店頭デリバティブ取引報告の対象者である場合は双方分が報告されているため、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

(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) 〕

	～1年	1年～5年	5年～	総計
銀行等	37.8	76.6	29.5	143.8
	(7,179)	(16,317)	(5,782)	(29,278)
大手行等	32.5	65.6	22.9	121.0
	(5,831)	(13,433)	(4,745)	(24,009)
地域銀行	3.7	3.7	1.1	8.5
	(1,052)	(2,226)	(451)	(3,729)
外国銀行支店その他銀行	1.5	7.3	5.5	14.3
	(296)	(658)	(586)	(1,540)
第一種金融商品取引業者	19.4	34.5	21.9	75.8
	(2,664)	(6,993)	(7,175)	(16,832)
保険会社	0.3	1.9	4.0	6.2
	(114)	(591)	(1,654)	(2,359)
清算機関	-	-	-	-
	-	-	-	-
上記計	57.5	112.9	55.4	225.8
	(9,957)	(23,901)	(14,611)	(48,469)

(注1) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社の残高には、清算機関が債務引受を行った取引の残高は含まれない。

(注2) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社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) 清算機関の残高は、清算機関が国内の銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社から債務引受を行った取引の残高を記載している。

(注5) 清算機関から報告される取引については、債務引受の相手方が双方とも店頭デリバティブ取引報告の対象者である場合は双方分が報告されているため、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

### (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	214.8	9.8	0.7	31.6	28.8	285.8
	(97,262)	(1,852)	(306)	(7,180)	(11,362)	(117,962)
大手行等	193.1	9.5	0.7	30.5	21.9	255.6
	(70,361)	(1,722)	(279)	(6,777)	(7,006)	(86,145)
地域銀行	10.8	0.2	-	0.1	1.7	12.8
	(23,367)	(109)	-	(136)	(2,127)	(25,739)
外国銀行支店その他銀行	10.9	0.1	0.1	1.1	5.2	17.4
	(3,534)	(21)	(27)	(267)	(2,229)	(6,078)
第一種金融商品取引業者	113.4	11.3	3.9	100.0	37.8	266.4
	(31,449)	(2,434)	(921)	(15,107)	(9,897)	(59,808)
保険会社	3.0	-	0.3	2.6	0.0	5.8
	(495)	-	(4)	(175)	(21)	(695)
清算機関	2,753.7	561.0	142.1	-	113.0	3,569.8
	(302,432)	(55,090)	(7,131)	-	(10,337)	(374,990)
上記計	3,084.9	582.0	147.1	134.2	179.6	4,127.8
	(431,638)	(59,376)	(8,362)	(22,462)	(31,617)	(553,455)

(注1) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社の残高には、清算機関が債務引受を行った取引の残高は含まれない。

(注2) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社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) 清算機関の残高は、清算機関が国内の銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社から債務引受を行った取引の残高を記載している。

(注5) 清算機関から報告される取引については、債務引受の相手方が双方とも店頭デリバティブ取引報告の対象者である場合は双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注6) 「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、翌日物金利を参照する金利スワップのことを指す。「スワップション」とは、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7) 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	23.3	34.9	85.6	143.8
	(7,625)	(10,310)	(11,343)	(29,278)
大手行等	20.4	19.6	81.0	121.0
	(7,100)	(6,530)	(10,379)	(24,009)
地域銀行	0.1	4.8	3.6	8.5
	(287)	(2,643)	(799)	(3,729)
外国銀行支店その他銀行	2.8	10.5	1.0	14.3
	(238)	(1,137)	(165)	(1,540)
第一種金融商品取引業者	8.2	9.8	57.7	75.8
	(3,133)	(3,673)	(10,026)	(16,832)
保険会社	2.9	3.3	0.0	6.2
	(712)	(1,645)	(2)	(2,359)
清算機関	-	-	-	-
	-	-	-	-
上記計	34.5	48.0	143.4	225.8
	(11,470)	(15,628)	(21,371)	(48,469)

(注1) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社の残高には、清算機関が債務引受を行った取引の残高は含まれない。

(注2) 銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社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) 清算機関の残高は、清算機関が国内の銀行等、第一種金融商品取引業者及び保険会社から債務引受を行った取引の残高を記載している。

(注5) 清算機関から報告される取引については、債務引受の相手方が双方とも店頭デリバティブ取引報告の対象者である場合は双方分が報告されているため、重複して計上している。

(注6) 「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、「固定-固定」とは固定金利同士を交換する金利スワップ、「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7) 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。