June 2024

JFSA PUBLIC REPORTING - OTC DERIVATIVES

金融商品取引業者等から DTCC Data Repository Japan K.K が報告を受けている店頭デリバティブ取引情報の集計を行いましたので、金融商品取引法第 156 条の 66 第 1 項の規定に基づき、この結果を公表いたします。
尚、様式は、金融庁の様式と同一的・統一的にしているに過ぎません。

Pursuant to Article 156-66 of the Financial Instruments and Exchange Act, DDRJ publishes a report on over-the-counter (OTC) derivatives. This report aggregates OTC derivatives transactions data which are reported to DDRJ by the Financial Instruments Business Operators, etc. in Japan.
The report format is the same and unified only as the format that is published by JFSA.

注：想定元本額は切り捨てで計算されているため、各テーブルを比較すると、想定元本額の小数点以下の数字が異なる場合がございます。

2024 年 4 月分　備考

1．金利関連取引

下記テーブルにて一部の取引がその他の区分に反映されてないため、下記の通り表を修正いたしました。

（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

	固定－変動	変動－変動	スワップション	その他	総計
大手行等	104.8	23	34.6	17.0	179.4
	34053	3583	8109	1789	47534
地域銀行	10.4	0	0	0.1	10.5
	14740	6	4	237	14987
外国銀行支店その他銀行	6.9	0.5	1	1.4	9.8
	1239	19	830	126	2214
小計 (銀行等)	122.1	23.5	35.6	18.5	199.7
	50032	3608	8943	2152	64735
第一種金融商品取引業者	61.2	3	189.7	65.3	319.2
	17462	1152	24101	6949	49664
保険会社	0.7	0	2.8	10.4	13.9
	125	3	232	15	375
清算機関	5871.8	359.7	-	88.9	6320.4
	495152	41167	-	1579	537898
上記計	6055.8	386.2	228.1	183.1	6853.2
	562771	45930	33276	10695	652672

下記テーブルにて一部の取引が表に反映されてないため、下記の通り表を修正いたしました。

（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

	固定-変動	固定-固定	変動-変動	その他	総計
大手行等	27.8	338.5	107.1	-	473.4
	6131	4393	12408	-	22932
地域銀行	1.2	6.1	2.5	-	9.8
	238	2523	295	-	3056

DTCC Public (White)

外国銀行支店その他銀行	5.7	22.1	4.1	0.1	32.0
	274	1823	161	15	2273
小計 (銀行等)	34.7	366.7	113.7	0.1	515.2
	6643	8739	12864	15	28261
第一種金融商品取引業者	10.4	14.2	62.2	1.7	88.5
	2508	4491	12254	291	19544
保険会社	0.6	14.3	0	-	14.9
	38	4334	1	-	4373
清算機関	0.4	-	0.3	-	0.7
	184	-	52	-	236
上記計	46.1	395.2	176.2	1.8	619.3
	9373	17564	25171	306	52414

2024 年 5 月分　備考

1．金利関連取引

下記テーブルにて一部の取引がその他の区分に反映されてないため、下記の通り表を修正いたしました。

（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

	固定－変動	変動－変動	スワップション	その他	総計
大手行等	106	23.2	36	17.1	182.3
	34066	3632	8171	1799	47668
地域銀行	10.5	0	0	0.1	10.6
	14782	6	1	238	15027
外国銀行支店その他銀行	6.5	0.7	1.1	1.4	9.7
	1288	28	898	137	2351
小計 (銀行等)	123	23.9	37.1	18.6	202.6
	50136	3666	9070	2174.0	65046
第一種金融商品取引業者	66.1	3.1	197.3	67.0	333.5
	18309	1167	25324	7433	52233
保険会社	0.8	0	2.7	10.9	14.4
	125	3	228	218	574
清算機関	6211.5	356.1	-	74.4	6642.0
	509652	40800	-	1285	551737
上記計	6401.4	383.1	237.1	170.9	7192.5
	578222	45636	34622	11110.0	669590

下記テーブルにて一部の取引が表に反映されてないため、下記の通り表を修正いたしました。

（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

	固定-変動	固定-固定	変動-変動	その他	総計
大手行等	27.6	337.1	109.1	-	473.8
	6109	4350	12582	-	23041
地域銀行	1.3	6.6	2.6	-	10.5
	247	2705	301	-	3253
外国銀行支店その他銀行	5.9	22.4	4.3	0.1	32.7
	279	1847	170	15	2311
小計 (銀行等)	34.8	366.1	116	0.1	517.0
	6635	8902	13053	15	28605
第一種金融商品取引業者	10.7	15.5	66.1	1.7	94.0
	2537	4677	12677	288	20179
保険会社	0.6	14.4	0	-	15.0
	38	4311	1	-	4350
清算機関	0.4	-	0.3	-	0.7
	176	-	52	-	228
上記計	46.5	396	182.4	1.8	626.7
	9386	17890	25783	303	53362