本件の対外公表は
2025年3月13日
8時50分

デリバティブ取引に関する定例市場報告

（日本分集計結果：2024年12月末）

参考図表

照会先
日本銀行金融市場局総務課市場統計グループ
Tel：03-3279-1111（内線 2841）
電子メール：post.fmd13@boj.or.jp

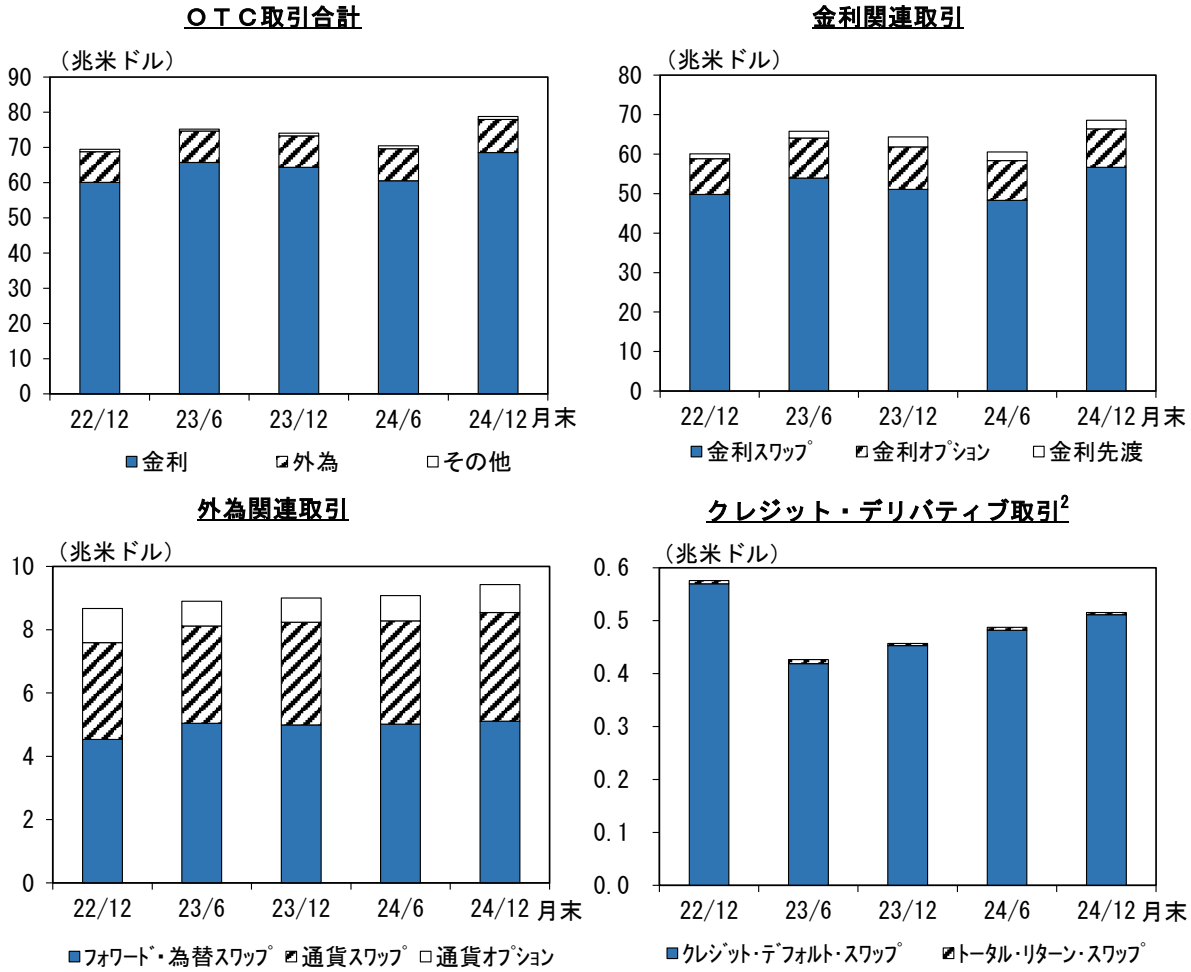
１．デリバティブ取引残高（想定元本）[1]

（単位：兆米ドル）

	22/12月末	23/6月末	23/12月末	24/6月末	24/12月末
ＯＴＣ取引合計	69.5 (+9.9%)	75.2 (+8.3%)	74.1 (▲1.5%)	70.4 (▲4.9%)	78.8 (+11.8%)
うち金利関連取引	60.1 (+11.5%)	65.8 (+9.4%)	64.3 (▲2.1%)	60.5 (▲5.9%)	68.6 (+13.3%)
外為関連取引	8.7 (+0.2%)	8.9 (+2.6%)	9.0 (+1.1%)	9.1 (+0.9%)	9.4 (+3.8%)
ｸﾚｼﾞｯﾄ･ﾃﾞﾘﾊﾞﾃｨﾌﾞ取引	0.6 (+12.4%)	0.4 (▲25.9%)	0.5 (+7.2%)	0.5 (+6.6%)	0.5 (+5.8%)
取引所取引合計	6.2 (▲18.1%)	8.8 (+42.6%)	4.0 (▲54.6%)	4.0 (▲0.7%)	3.7 (▲5.7%)
うち金利関連取引	5.9 (▲17.8%)	8.5 (+43.1%)	3.7 (▲56.5%)	3.5 (▲4.6%)	3.3 (▲6.2%)

２．ＯＴＣ取引残高（想定元本）の内訳

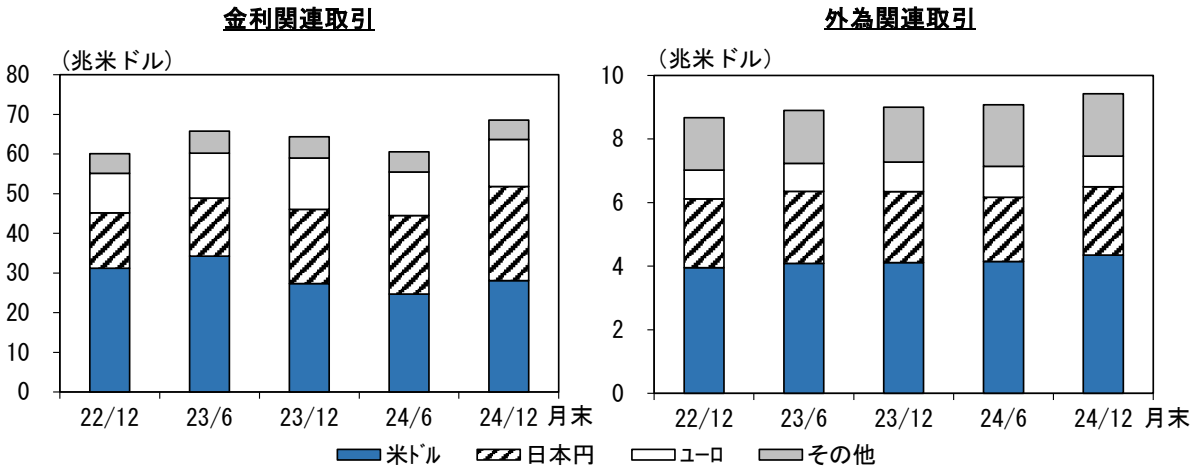
(1) リスク・ファクター / 商品別



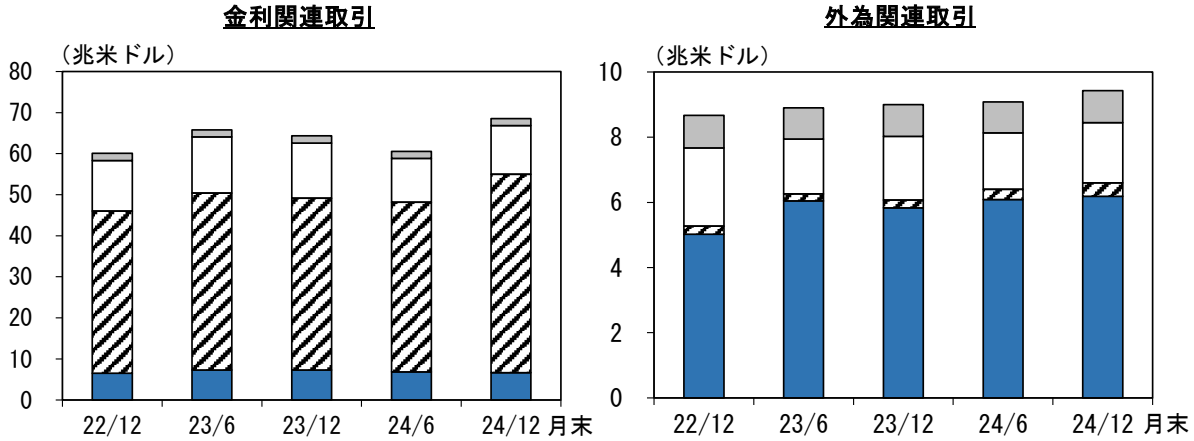
[1] 計数は連結ベース。（　）内は前期比。

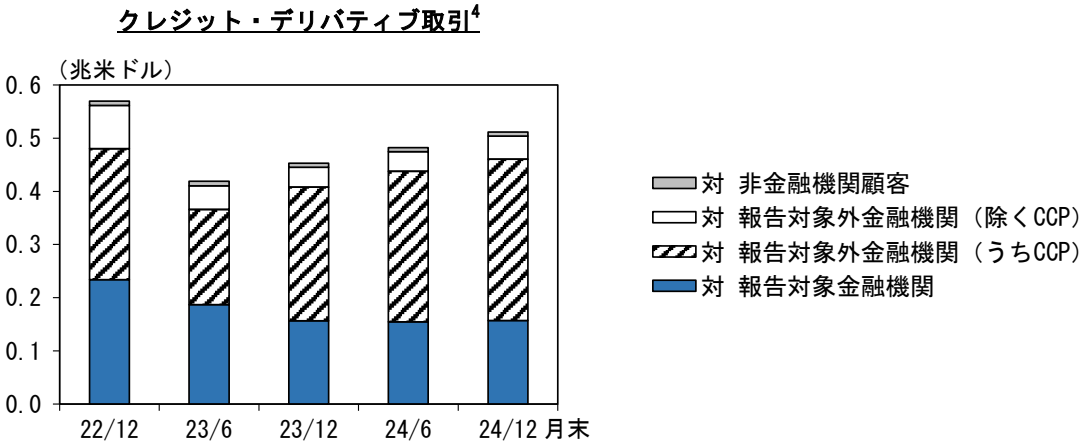
[2] クレジット・スプレッド商品も集計対象だが、残高が0のため省略している。

(2) 通貨別



(3) 取引相手先別[3]

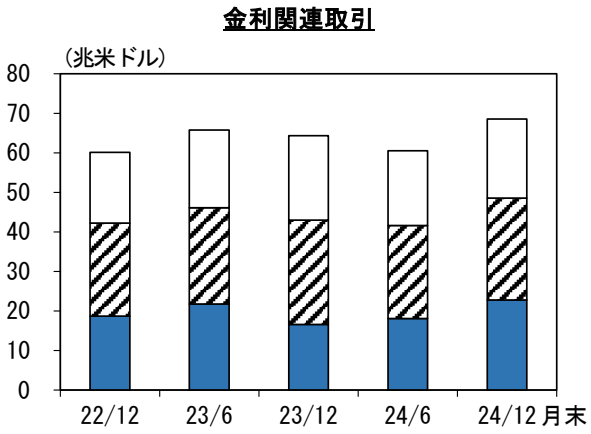


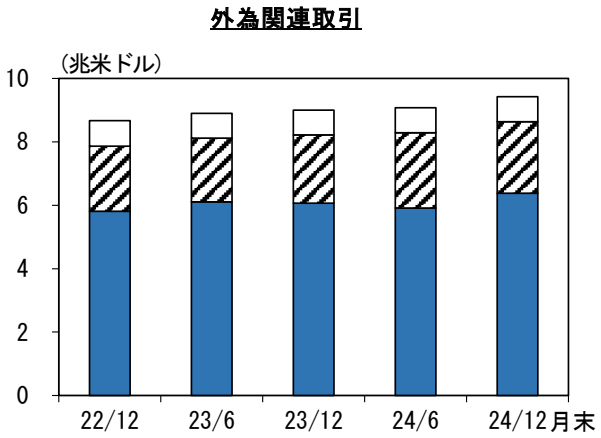


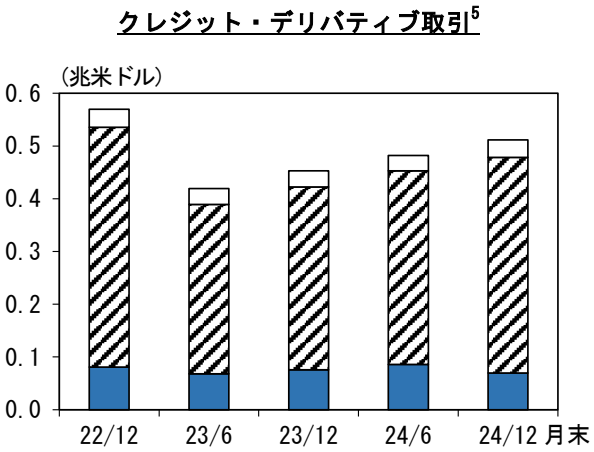
[3] 「報告対象金融機関」には、わが国の主要デリバティブ・ディーラー、およびグローバル・ベースの調査に参加した他国の主要デリバティブ・ディーラーを含む。

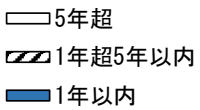
[4] 取引相手先別内訳が存在する「クレジット・デフォルト・スワップ」の計数を使用。

(4) 残存期間別









[5] 残存期間別内訳が存在する「クレジット・デフォルト・スワップ」の計数を使用。

（参考）「デリバティブ取引に関する定例市場報告」の概要[6]

本調査は、金融機関の協力に基づき作成されるものであり、本邦からは以下の主要ディーラー16先が参加している。

みずほ銀行、三菱UFJ銀行、三井住友銀行、りそな銀行、三菱UFJ信託銀行、みずほ信託銀行、三井住友信託銀行、SBI新生銀行、あおぞら銀行、ゆうちょ銀行、野村ホールディングス、大和証券、みずほ証券、三菱UFJ証券ホールディングス、信金中央金庫、農林中央金庫

本調査では、リスク・ファクターを(1)外為、(2)金利、(3)エクイティ、(4)コモディティ、(5)クレジット、(6)その他の6種類に分け、(1)商品別、(2)通貨別（地域別）、(3)取引相手先別、(4)残存期間別に、想定元本および正・負の市場価値について、連結ベースの計数をドル建てベースで集計している。

また、本調査では報告対象金融機関相互の取引の二重計上を調整していない。なお、国際決済銀行より追って公表されるグローバル・ベースの残高では、二重計上が調整される予定。

[6] 詳細については、日本銀行ホームページ「『デリバティブ取引に関する定例市場報告』の解説」（https://www.boj.or.jp/statistics/outline/exp/exyosi.htm）を参照。