

「コール市場関連統計」の解説

作成部署、作成周期、公表時期等

作成部署：金融市場局

作成周期：日次

公表時期：定期データ更新日時の通り

公表方法：インターネット・ホームページ

刊行物等：なし

データ始期：無担保コール O/N 物レート 1997 年 11 月

上記以外 2017 年 1 月

1. 公表内容

本邦コール市場において、情報提供会社が媒介した取引（有担保コールおよび無担保コールにおけるブローキング取引）および一方の当事者となった取引（有担保コールにおけるディーリング取引）にかかる以下のデータを公表しています。

(1) コールレート（最高値、最低値、加重平均値）

| | 有担保コール | 無担保コール |
|------------|--|---|
| 翌日物 ・ O/N物 | (翌日物) 有担保コール市場における、当日約定、当日資金受渡し、翌営業日を期日とする条件で成立した取引のレート | (O/N物) 無担保コール市場における、当日約定、当日資金受渡し、翌営業日を期日とする条件で成立した取引のレート |
| T/N物 | コール市場において、約定日の翌営業日に資金受渡し、資金受渡し日の翌営業日を期日とする条件で成立した取引のレート | |
| S/N物 | コール市場において、約定日の翌々営業日に資金受渡し、資金受渡し日の翌営業日を期日とする条件で成立した取引のレート | |
| 期日物・ターム物 | コール市場において、取引期間が2営業日以上となる条件で成立した取引のレート | |

(注1) 有担保コールはブローキング取引のみ（ディーリング取引は含みません）。

(注2) オッド物は含みません。

(2) 無担保コールO/N物取引の出来高

無担保コール市場において、当日に無担保コールO/N物取引として約定が成立した取引の合計金額。

(3) 有担保/無担保コール市場残高

有担保/無担保コール市場において、当日までに約定および資金受渡しが完了している取引のうち、期日到来前の取引の合計金額。

(注1) 有担保コールは、ブローキング取引とディーリング取引の合計。

(注2) オッド物を含みます。

2. コールレートの算出方法

コールレートの加重平均値は、算出対象取引のレートを、レート毎の出来高*で加重平均したものです。情報提供会社**から提供されるデータをもとに、レート毎の積数***の合計値をレート毎の出来高の合計値で除すことによつて算出します(小数点第3位まで<単位未満四捨五入>)。

また、最高値(最低値)については、各情報提供会社から提供を受けた最高値(最低値)のうち最も高いもの(低いもの)としています。

(*) レート毎の出来高は、約定が成立した取引の金額。

(**) 現在の情報提供会社は以下のとおりです。

- ・上田八木短資株式会社
 - ・セントラル短資株式会社
 - ・東京短資株式会社
- (五十音順・敬称略)

(***) 積数は、約定が成立した取引のレートに、その出来高を乗じたもの。

3. 公表方法

コール市場関連統計については、以下の日本銀行のホームページにおいて公表します。公表時刻は下表のとおりです。

http://www3.boj.or.jp/market/jp/menu_m.htm

| | 速報値 | 確報値 |
|----------------------|---|-------------|
| コールレート | 当日の午後5時15分頃(年 末日を除く月末日は午後6時 15分頃) | 翌営業日の午前10時頃 |
| 無担保コールO/N物 取引の出来高 | | |
| コール市場残高 | | |