

金利スワップ取引

- 18 年は、当初の発行計画と実際の発行が乖離するケースで、利払コストと金利リスクとのバランスを回復するために実施。

- ・ 個人向け国債発行額が計画計上額に比べ増加 ⇒ 10 年固定金利払い

(以下は、18 年度下期より実施)

- ・ 流動性供給入札を 18 年度下期に継続 ⇒ 10 年超 20 年以下の固定金利受け
- ・ 第 II 非価格競争入札が計画計上額に比べ増加 ⇒ 2 年又は 5 年の固定金利受け

○ 取引状況 (18 年 1 月～9 月)

年 限	取引回数	受け	払い
3 年以下	—	—	—
3 年超 7 年以下	—	—	—
7 年超 10 年以下	8 回	—	4,000 億円
10 年超	—	—	—
合 計	8 回	—	4,000 億円

(注) 18 年度下期の取引状況は 19 年 4 月に開示予定。

- これまでの取引について、市場関係者からは、マーケットへのインパクトはニュートラルとの評価。