

# *Tokyo Foreign Exchange Market Committee*

## 「東京外国為替市場における外国為替取引高サーベイ」の結果について

平成18年7月18日

時下 ますますご清栄のこととお喜び申し上げます。

さて、東京外国為替市場委員会は、本年4月中の外国為替取引を対象とした第一回「東京外国為替市場における外国為替取引高サーベイ」の結果を別紙の通り公表致します。

近年、外国為替市場では、ヘッジファンドや個人投資家といった新しい参加者による取引ボリュームの増大、電子取引の浸透、エマージング通貨への取組の活発化など様々な変化が目覚ましい勢いで進行しております。

本サーベイは、東京外国為替市場におけるこのような変化をタイムリーかつ的確に把握し、市場参加者の皆様の今後の業務にお役立て頂くと共に、東京市場の発展の一助となることを目的として当委員会が企画、実施したものであり、今後も年に一度のペースで実施していく予定としています。

尚、本サーベイには別紙の21金融機関が参加致しておりますが、データの収集及び結果の集計等個社情報に関わる事務につきましては、日本銀行金融市場局にご担当頂いております。

< 本件に関する照会先 >

東京外国為替市場委員会 議長  
内田信幸 (三菱東京UFJ銀行市場業務部)  
電話：03 - 6268 - 1131  
E-Mail：[nobuyuki\\_uchida@mufg.jp](mailto:nobuyuki_uchida@mufg.jp)

東京外国為替市場委員会 書記  
井上哲也 (日本銀行金融市場局)  
電話：03 - 3277 - 2917  
E-Mail：[tetsuya.inoue@boj.or.jp](mailto:tetsuya.inoue@boj.or.jp)

## *Tokyo Foreign Exchange Market Committee*

注-1)

「東京外国為替市場における外国為替取引高サーベイ」は、国際決済銀行（BIS）が実施している「外国為替およびデリバティブに関する中央銀行サーベイ」（以下、「BIS サーベイ」と略）と類似していますが、調査方法の面で異なる点があります。主な相違点は、本サーベイではトレーディングデスクの所在地を報告のベースとしているのに対し、BIS サーベイではセールスデスクの所在地を報告のベースとしている点です。

注-2)

本サーベイと同様の調査が、ロンドン、ニューヨーク、シンガポールの各市場においても実施されており、各々の外国為替市場委員会より発表されています。結果につきましては、下記のホームページをご参照ください。

- ・ Foreign Exchange Joint Standing Committee's survey (London)  
[www.bankofengland.co.uk/markets/forex/fxjsc/index.htm](http://www.bankofengland.co.uk/markets/forex/fxjsc/index.htm)
- ・ Foreign Exchange Committee's Survey (New York)  
[www.newyorkfed.org/fxc/volumesurvey](http://www.newyorkfed.org/fxc/volumesurvey)
- ・ Singapore Foreign Exchange Market Committee's Survey  
[www.sfemc.org](http://www.sfemc.org)

# *Tokyo Foreign Exchange Market Committee*

## 報告金融機関

バンク・オブ・アメリカ・エヌ・エイ  
三菱東京 UFJ 銀行  
バークレイズ銀行東京支店  
シティバンク、エヌ・エイ  
カリヨン銀行  
ドイツ銀行東京支店  
ゴールドマン・サックス証券会社  
JP モルガン・チェース銀行  
リーマン・ブラザーズ証券会社東京支店  
メリルリンチ日本証券  
三菱 UFJ 信託銀行  
みずほ銀行  
みずほコーポレート銀行  
モルガン・スタンレー証券株式会社  
野村証券株式会社  
ロイヤルバンク・オブ・スコットランド東京支店  
ソシエテジェネラル銀行東京支店  
ステート・ストリート銀行東京支店  
三井住友銀行  
住友信託銀行  
UBS 銀行東京支店

<表1> 外国為替取引高 (1営業日平均取引高)

(単位：億ドル、%、< >内はシェア)

	2006年4月中
スポット	661 < 29.0 >
為替スワップ	1,261 < 55.4 >
フォワード	279 < 12.3 >
通貨オプション	75 < 3.3 >
合計	2,277

<表2> 対インターバンク取引・対顧客取引（1営業日平均取引高）

（単位：億ドル、%、< >内はシェア）

		2006年4月中
対インターバンク取引 <sup>注1</sup>		1,638
スポット		495
		< 30.2 >
為替スワップ		1,019
		< 62.2 >
フォワード		71
		< 4.4 >
通貨オプション		53
		< 3.2 >
対顧客取引 <sup>注2</sup>		639
スポット		166
		< 26.0 >
為替スワップ		243
		< 38.0 >
フォワード		208
		< 32.6 >
通貨オプション		22
		< 3.5 >

注1 「対インターバンク取引」とは、マーケットにおいて市場参加者であると認知され、社内管理上もその扱いをしている相手先との取引。

注2 「対顧客取引」はインターバンク以外の相手先との取引。

<表3> 対国内取引・対国外取引<sup>注1</sup> (1営業日平均取引高)

(単位：億ドル,%, < >内はシェア)

		2006年4月中
対国内取引		743
スポット		206 < 27.7 >
為替スワップ		312 < 42.0 >
フォワード		203 < 27.3 >
通貨オプション		22 < 3.0 >
対国外取引		1,533
スポット		455 < 29.7 >
為替スワップ		949 < 61.9 >
フォワード		77 < 5.0 >
通貨オプション		53 < 3.4 >

注1 「国内」・「国外」の区別は、トレーディング・デスクの所在地をベースとする。また、「国外」には、自行・自社の海外支店・海外現地法人を含む。

<表4> 通貨別取引高動向（1営業日平均取引高）

（単位：億ドル、%、< >内はシェア）

	円を対価とする取引			ドルを対価とする取引				その他通貨ペア	合計
	USD	EUR	その他	EUR	GBP	AUD	その他		
スポット	345	60	57	87	17	27	56	13	661
	<27.1>	<43.7>	<39.6>	<34.9>	<39.1>	<16.2>	<22.8>	<69.9>	<29.0>
為替スワップ	765	15	32	140	25	131	151	2	1,261
	<60.1>	<11.0>	<22.6>	<56.4>	<55.5>	<79.2>	<61.5>	<11.2>	<55.4>
フォワード	121	52	47	19	2	4	32	2	279
	<9.5>	<38.1>	<32.9>	<7.7>	<5.0>	<2.4>	<13.1>	<11.4>	<12.3>
通貨オプション	43	10	7	3	0	4	7	1	75
	<3.4>	<7.3>	<5.0>	<1.1>	<0.5>	<2.2>	<2.7>	<7.5>	<3.3>
合計	1,274	137	143	249	44	165	245	18	2,277

注 USD：米ドル、EUR：ユーロ、GBP：ポンド、AUD：豪ドル

<表5> 取引形態別取引高（1営業日平均取引高）

（単位：億ドル、%、< >内はシェア）

		2006年4月中
対インターバンク取引		1,638
ホイスローカー経由の取引		342
		< 20.9 >
電子ブローキング・システムを利用した取引 （EBS・ロイターマッチング）		280
		< 17.1 >
電子トレーディング・システムを利用した取引 <sup>注</sup>		37
		< 2.2 >
その他の取引 （電話やロイターカンパセッションによるDD取引等）		979
		< 59.8 >
対顧客取引		639
電子トレーディング・システムを利用した取引 <sup>注</sup>		97
		< 15.2 >
その他の取引（電話等による取引）		542
		< 84.8 >

注 「電子トレーディング・システム」とは、個別行提供のインターネット・トレーディング・システム、およびマルチバンクのトレーディング・システムを指す（例：FXAll、FXConnect、Currenex、eSpeed等）。



<表6> アジア通貨・エマージング通貨を対価とする取引高動向（1営業日平均取引高）

（単位：億ドル）

	HKD	SGD	TWD	KRW	THB	IDR	INR	MYR	PHP	CNY	BRL	RUB	ZAR
スポット	27.6	11.1	2.2	6.9	1.5	0.3	1.3	0.2	0.3	1.0	0.0	0.0	3.3
為替スワップ	45.1	48.7	0.0	0.7	5.1	0.0	0.0	0.0	0.0	0.1	0.0	0.0	5.1
フォワード	3.4	21.7	7.0	12.3	4.4	0.5	1.4	0.5	1.3	3.2	0.0	0.1	0.4
うちNDF	0.0	0.0	7.0	9.5	0.0	0.5	1.4	0.5	1.2	3.2	0.0	0.1	0.0
合計	76.2	81.5	9.3	19.9	11.0	0.9	2.8	0.8	1.6	4.3	0.0	0.1	8.8

注 HKD：香港ドル、SGD：シンガポール・ドル、TWD：新台湾ドル、KRW：韓国ウォン、THB：タイ・バーツ、IDR：インドネシア・ルピア、INR：インド・ルピー、MYR：マレーシア・リンギ、PHP：フィリピン・ペソ、CNY：中国・人民元、BRL：ブラジル・リアル、RUB：ロシア・ルーブル、ZAR：南アフリカ・ランド

<表7> 外国為替取引集中度（シェア）

（単位：％）

	第1四分位 （上位1～5先）	第2四分位 （上位6～10先）	第3四分位 （上位11～15先）	第4四分位 （上位16～21先）
スポット	62.5	23.9	9.5	4.2
為替スワップ	59.5	25.1	10.7	4.8
フォワード	58.5	23.5	13.1	4.9
通貨オプション	79.2	13.8	6.1	0.9
合計	57.0	26.4	11.0	5.6

（相手別）

（単位：％）

	第1四分位 （上位1～5先）	第2四分位 （上位6～10先）	第3四分位 （上位11～15先）	第4四分位 （上位16～21先）
対インターバンク取引	61.3	23.4	10.9	4.4
対顧客取引	62.4	24.1	10.3	3.2

（通貨別）

（単位：％）

	第1四分位 （上位1～5先）	第2四分位 （上位6～10先）	第3四分位 （上位11～15先）	第4四分位 （上位16～21先）
円を対価とする取引 （全取引）	58.2	25.0	10.8	6.0
円を対価とする取引 （対ドル）	62.2	22.2	10.5	5.1

## 【合算表】

## ＜別添1＞スポット、為替スワップ、フォワード、通貨オプション取引高(2006年4月中)

(百万ドル)

	円を対価とする取引			ドルを対価とする取引				その他 通貨ペア	合計
	USD	EUR	その他	EUR	GBP	AUD	その他		
<b>スポット</b>									
対インターバンク	512,425	77,814	37,614	157,140	31,695	50,259	99,608	23,403	989,957
国内	94,866	15,312	6,747	15,051	2,756	2,058	4,747	736	142,273
国外	417,559	62,502	30,867	142,088	28,938	48,200	94,861	22,667	847,684
対顧客	177,213	42,341	75,656	16,406	3,092	3,349	12,118	2,265	332,440
国内	147,882	38,146	72,607	7,626	1,963	605	949	345	270,123
国外	29,330	4,195	3,049	8,780	1,129	2,744	11,169	1,920	62,316
<b>スポット計</b>	<b>689,638</b>	<b>120,155</b>	<b>113,270</b>	<b>173,546</b>	<b>34,786</b>	<b>53,608</b>	<b>111,726</b>	<b>25,668</b>	<b>1,322,397</b>
<b>為替スワップ</b>									
対インターバンク	1,215,310	12,080	8,921	261,975	45,702	230,511	261,656	1,378	2,037,533
国内	336,530	3,858	4,952	53,897	1,275	33,227	15,117	0	448,856
国外	878,780	8,222	3,968	208,079	44,428	197,284	246,539	1,378	1,588,677
対顧客	315,497	18,027	55,663	18,457	3,652	31,153	39,864	2,731	485,044
国内	94,039	17,084	50,686	8,610	268	446	3,014	944	175,091
国外	221,458	943	4,977	9,847	3,384	30,707	36,850	1,787	309,953
< 期間 >									
1週間以内	1,118,194	7,787	53,667	207,579	39,378	248,907	273,088	2,624	1,951,225
1週間超1年以内	401,826	22,159	10,903	70,858	9,977	12,756	28,016	1,486	557,982
1年超	10,785	161	12	1,998	0	0	416	0	13,372
<b>為替スワップ計</b>	<b>1,530,807</b>	<b>30,107</b>	<b>64,584</b>	<b>280,432</b>	<b>49,354</b>	<b>261,664</b>	<b>301,520</b>	<b>4,109</b>	<b>2,522,577</b>
<b>フォワード</b>									
対インターバンク	41,778	12,411	9,762	20,850	3,263	5,839	46,316	2,288	142,507
国内	9,991	7,258	4,913	2,938	652	268	2,529	171	28,720
国外	31,787	5,154	4,849	17,912	2,611	5,571	43,787	2,117	113,787
対顧客	199,261	92,316	84,245	17,407	1,169	1,981	17,794	1,918	416,092
国内	186,518	90,720	82,939	12,355	587	552	1,986	1,103	376,760
国外	12,743	1,596	1,306	5,052	582	1,429	15,808	815	39,332
< 期間 >									
1週間以内	105,580	38,925	59,092	18,801	2,038	2,437	15,746	2,226	244,846
1週間超1年以内	131,134	65,032	34,664	19,275	2,392	5,381	46,373	1,976	306,226
1年超	4,324	769	252	181	0	0	1,990	4	7,521
<b>フォワード計</b>	<b>241,039</b>	<b>104,727</b>	<b>94,008</b>	<b>38,257</b>	<b>4,431</b>	<b>7,820</b>	<b>64,110</b>	<b>4,207</b>	<b>558,599</b>
<b>通貨オプション</b>									
対インターバンク	55,996	13,526	10,989	4,150	424	6,382	11,382	2,429	105,279
国内	7,086	1,228	2,098	98	0	37	10	0	10,557
国外	48,910	12,298	8,891	4,052	424	6,345	11,372	2,429	94,722
対顧客	30,637	6,406	3,194	1,222	2	753	1,807	331	44,352
国内	24,618	6,220	2,643	283	0	157	85	1	34,006
国外	6,020	186	551	939	2	596	1,722	330	10,346
< 期間 >									
1週間以内	6,975	1,690	1,230	1,099	214	1,321	396	207	13,132
1週間超1年以内	66,855	17,162	11,295	4,260	212	5,517	10,522	2,509	118,332
1年超	12,804	1,082	1,658	13	0	296	2,272	44	18,169
<b>通貨オプション計</b>	<b>86,634</b>	<b>19,932</b>	<b>14,182</b>	<b>5,372</b>	<b>426</b>	<b>7,135</b>	<b>13,189</b>	<b>2,760</b>	<b>149,631</b>

注1) 「取引高」とは、調査期間1か月間(2006年4月中)に締結された新たな取引の総額。想定元本ベース(スポット、フォワードは契約額面ベース)。

注2) 「インターバンク」とは、マーケットにおいて市場参加者であると認知され、社内管理上もその扱いをしている相手先。「顧客」はそれ以外の相手先。

注3) 「国内」「国外」の区別は、トレーディング・デスクの所在地をベースとする。また、「国外」には、自行・自社の海外支店・海外現地法人を含む。

注4) スポット: 約定日から2営業日以内に決済される外為取引。但し、スワップ取引のスポット側の足は計上しない。

為替スワップ: 一定期間に亘り、特定の想定元本をベースに生じるキャッシュ・フローを交換することを当事者間で約定した取引。フォワード側の足のみ計上。

フォワード: 将来の特定時点(2営業日超)において、特定の価格や利回りに基づき、特定の金融商品を、売買することを約定する取引。FXA、NDFを含む。

通貨オプション: 約定期間に特定の為替レートで他通貨の売買を行うことができる権利を売買する取引。

注5) 米ドルを対価としない取引は、取引日の実勢レートで米ドル換算。不可能な場合は月中の平均レートまたは月末レートでの換算。

注6) 計数は1百万ドル単位。1百万ドル未満は四捨五入。

注7) 「期間」は、契約日よりも先の日付で取引が開始される場合、実際の取引開始日から取引終了日までの期間で区分。

【合算表】

<別添2> 取引形態別取引高(2006年4月中)

(百万ドル)

	円を対価とする取引			ドルを対価とする取引				その他 通貨ペア	合計
	USD	EUR	その他	EUR	GBP	AUD	その他		
<b>スポット</b>									
対インターバンク	512,427	77,814	37,616	157,135	31,695	50,258	99,610	23,408	989,962
┆ ｽﾌﾟｯﾄ ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ 経由の取引	32,459	4,497	619	10,559	459	1,883	1,855	509	52,840
┆ 電子ブローキング・システムを利用した取引 (EBS・ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ)	193,312	40,692	484	88,632	13,633	15,700	22,807	7,797	383,057
┆ 電子トレーディング・システムを利用した取引	20,386	2,760	4,834	5,848	1,744	1,097	2,858	1,243	40,770
┆ その他の取引 (電話やｲﾝﾀｰﾈｯﾄ によるDD取引等)	266,271	29,864	31,678	52,096	15,859	31,578	72,090	13,859	513,295
対顧客	177,222	42,340	75,656	16,407	3,092	3,350	12,118	2,271	332,456
┆ 電子トレーディング・システムを利用した取引	28,083	9,358	27,718	5,831	761	762	1,006	231	73,750
┆ その他の取引 (電話等による取引)	149,139	32,982	47,938	10,576	2,331	2,588	11,112	2,040	258,706
スポット計	689,649	120,154	113,272	173,542	34,786	53,608	111,728	25,679	1,322,418
<b>為替スワップ</b>									
対インターバンク	1,215,300	12,081	8,922	261,975	45,703	230,509	261,657	1,378	2,037,525
┆ ｽﾌﾟｯﾄ ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ 経由の取引	373,553	3,746	0	93,105	3,283	32,791	51,940	99	558,518
┆ 電子ブローキング・システムを利用した取引 (EBS・ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ)	88,936	1,090	379	36,537	9,959	10,353	19,693	0	166,947
┆ 電子トレーディング・システムを利用した取引	12,010	1,066	2,631	3,019	2,158	1,998	4,205	553	27,640
┆ その他の取引 (電話やｲﾝﾀｰﾈｯﾄ によるDD取引等)	740,801	6,179	5,911	129,314	30,303	185,367	185,819	726	1,284,420
対顧客	315,498	18,026	55,663	18,458	3,653	31,153	39,861	2,731	485,043
┆ 電子トレーディング・システムを利用した取引	32,299	4,965	35,834	5,375	2,257	1,430	3,436	2,179	87,775
┆ その他の取引 (電話等による取引)	283,199	13,061	19,829	13,083	1,396	29,723	36,425	552	397,268
為替スワップ計	1,530,798	30,107	64,585	280,433	49,356	261,662	301,518	4,109	2,522,568
<b>フォワード計</b>									
対インターバンク	41,777	12,409	9,761	20,850	3,263	5,838	46,317	2,286	142,501
┆ ｽﾌﾟｯﾄ ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ 経由の取引	5,007	177	265	6,296	0	1,796	17,642	52	31,235
┆ 電子ブローキング・システムを利用した取引 (EBS・ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ)	987	1,091	12	1,794	362	205	4,577	573	9,601
┆ 電子トレーディング・システムを利用した取引	2,044	1,023	226	445	137	248	309	341	4,773
┆ その他の取引 (電話やｲﾝﾀｰﾈｯﾄ によるDD取引等)	33,739	10,118	9,258	12,315	2,764	3,589	23,789	1,320	96,892
対顧客	199,262	92,316	84,246	17,407	1,170	1,983	17,793	1,920	416,098
┆ 電子トレーディング・システムを利用した取引	10,945	8,494	11,084	765	118	381	763	430	32,980
┆ その他の取引 (電話等による取引)	188,317	83,822	73,162	16,642	1,052	1,602	17,030	1,490	383,118
フォワード計	241,039	104,725	94,008	38,257	4,432	7,821	64,110	4,207	558,599
<b>通貨オプション</b>									
対インターバンク	55,997	13,526	10,989	4,150	423	6,381	11,383	2,429	105,279
┆ ｽﾌﾟｯﾄ ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ 経由の取引	22,192	4,520	4,268	1,903	241	2,213	5,835	773	41,946
┆ 電子ブローキング・システムを利用した取引 (EBS・ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ)	15	0	0	0	0	0	0	0	15
┆ 電子トレーディング・システムを利用した取引	1	0	2	0	0	14	0	0	17
┆ その他の取引 (電話やｲﾝﾀｰﾈｯﾄ によるDD取引等)	33,789	9,006	6,718	2,247	182	4,154	5,548	1,656	63,300
対顧客	30,637	6,406	3,194	1,222	2	752	1,807	331	44,351
┆ 電子トレーディング・システムを利用した取引	99	11	4	0	0	37	0	0	151
┆ その他の取引 (電話等による取引)	30,538	6,395	3,190	1,222	2	715	1,807	331	44,200
通貨オプション計	86,635	19,932	14,182	5,372	425	7,133	13,190	2,760	149,630

注1) 「取引高」とは、調査期間1ヵ月間(2006年4月中)に締結された新たな取引の総額。想定元本ベース(スポット、フォワードは契約額面ベース)。

注2) 「電子トレーディング・システム」とは、個別行提供のインターネットトレーディング・システム、およびマルチバンクのトレーディング・システムを指す(例: FXAll、FXConnect、Currenex、eSpeed等)。

【合算表】

## ＜別添3＞アジア通貨・エマージング通貨を対価とする直物、先物取引(2006年4月中)

(百万ドル)

	HKD	SGD	TWD	KRW	THB	IDR	INR	MYR	PHP	CNY	BRL	RUB	ZAR	合計
<b>スポット</b>														
対インターバンク	42,177	19,037	3,498	11,214	1,760	418	1,653	235	621	1,286	13	0	5,719	87,631
国内	856	247	41	298	87	0	22	0	1	0	0	0	19	1,571
国外	41,321	18,790	3,457	10,917	1,673	418	1,631	235	620	1,286	13	0	5,700	86,060
対顧客	13,103	3,205	989	2,558	1,173	220	1,026	177	76	647	17	0	794	23,985
国内	12,552	2,623	62	71	668	1	63	0	0	8	17	0	772	16,837
国外	551	582	927	2,487	505	219	963	177	76	639	0	0	22	7,148
スポット計	55,280	22,242	4,487	13,772	2,933	638	2,679	412	697	1,933	30	0	6,513	111,617
<b>為替スワップ</b>														
対インターバンク	78,911	89,080	35	439	9,464	30	60	60	7	21	0	0	8,325	186,431
国内	206	258	0	0	178	0	0	0	0	0	0	0	2	644
国外	78,705	88,822	35	439	9,285	30	60	60	7	21	0	0	8,323	185,787
対顧客	11,322	8,265	0	883	736	0	7	0	0	187	0	0	1,928	23,328
国内	122	187	0	0	57	0	0	0	0	0	0	0	1,102	1,468
国外	11,200	8,078	0	883	679	0	7	0	0	187	0	0	826	21,860
スワップ計	90,233	97,345	35	1,322	10,200	30	67	60	7	208	0	0	10,253	209,759
<b>フォワード</b>														
対インターバンク	3,225	14,907	8,823	16,438	4,241	809	2,129	744	1,642	3,660	8	0	50	56,676
国内	203	158	49	265	7	0	0	0	0	1	0	0	4	687
国外	3,022	14,749	8,774	16,173	4,234	809	2,129	744	1,642	3,659	8	0	46	55,989
対顧客	3,666	28,579	5,264	8,201	4,612	250	769	316	875	2,747	58	0	790	58,127
国内	3,376	28,123	3,859	193	4,116	0	0	40	751	63	31	0	788	41,340
国外	290	456	1,405	8,008	496	250	769	276	124	2,684	27	0	2	14,787
フォワード計	6,891	43,486	14,087	24,639	8,852	1,059	2,898	1,060	2,517	6,407	66	0	840	112,803
<b>NDF(上記フォワードの内訳)</b>														
対インターバンク	0	0	8,815	13,661	0	774	2,095	727	1,628	3,640	8	90	0	31,438
国内	0	0	49	265	0	0	0	0	0	1	0	0	0	315
国外	0	0	8,766	13,396	0	774	2,095	727	1,628	3,639	8	90	0	31,123
対顧客	0	0	5,262	5,427	0	250	642	286	860	2,745	58	90	0	15,620
国内	0	0	3,857	96	0	0	11	20	750	61	31	0	0	4,826
国外	0	0	1,405	5,331	0	250	631	266	110	2,684	27	90	0	10,794
NDF計	0	0	14,077	19,088	0	1,024	2,737	1,013	2,488	6,385	66	180	0	47,058

注1) 「取引高」とは、調査期間1ヵ月間(2006年4月中)に締結された新たな取引の総額。想定元本ベース(スポット、フォワードは契約額面ベース)。