



チャイエックス・ジャパン 月次統計レポート

2016年12月

月次統計値と傾向

Chi-X PTS

月間合計売買代金

JPY 855,573,058,423

月間合計売買高

863,173,257

売買代金シェア¹

1.4%

銘柄における売買高シェア¹

1.6%

一日平均売買代金

JPY 40,741,574,211

一日平均売買高

41,103,488

一日平均取引高

123,012

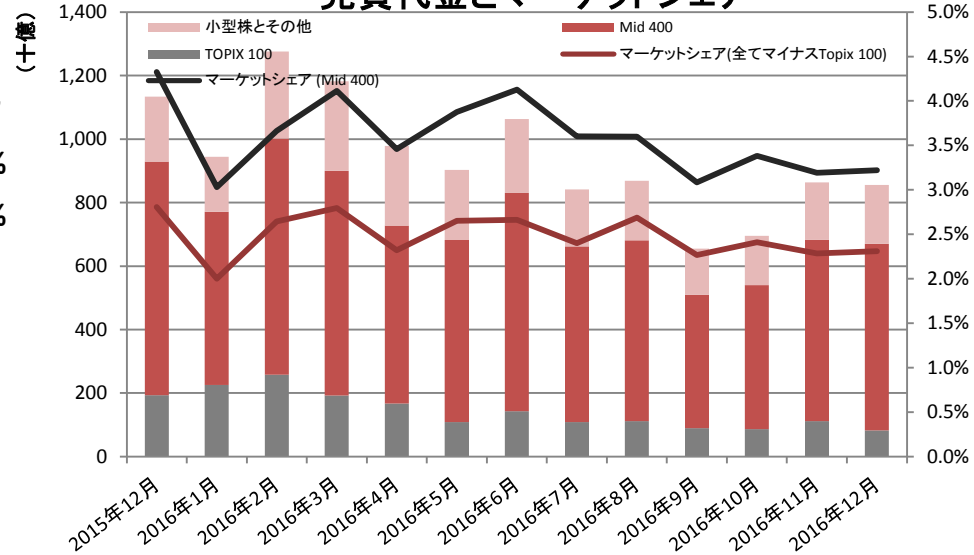
一日平均約定銘柄

1,733

一日平均気配銘柄

1,984

売買代金とマーケットシェア



Chi-Match

月間合計売買代金

JPY 56,256,079,788

月間合計売買高

38,070,122

約定件数

9,902

約定銘柄数

1,012

一日平均注文代金

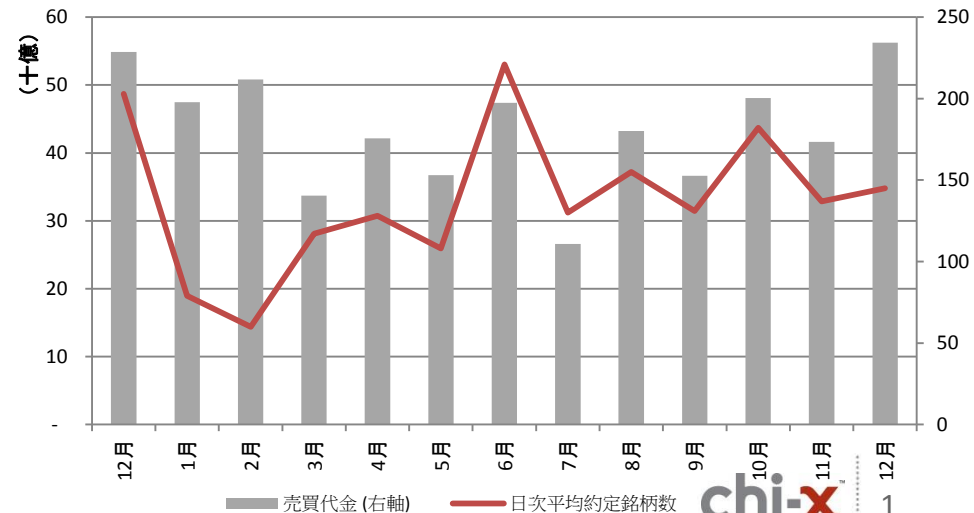
JPY 90,851,445,874

一日平均注文高

62,852,717

一日平均注文数

4,603



Chi-Match の売買代金は売り、買いの両方が含まれています。

¹対主市場比. 出典元: チャイエックス・ジャパン

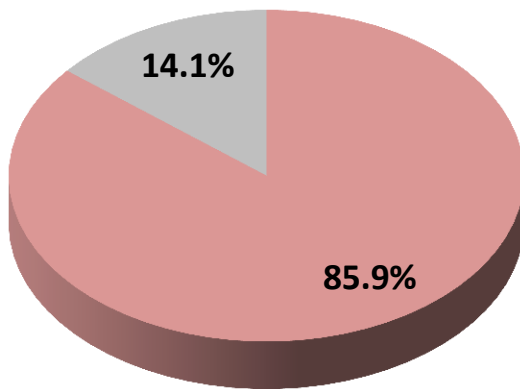
チャイエックスにおける価格改善効果¹

価格改善効果 (全体)

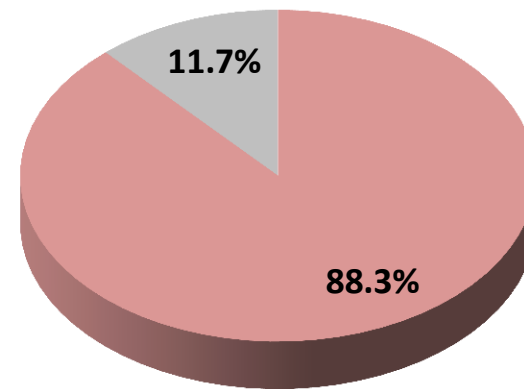
平均価格改善効果 (全体)	平均価格改善効果 (主市場最良気配価格内)	平均価格改善効果 (その他)
4.35	5.17	-0.60

価格改善効果 (全体 - TOPIX 100)

平均価格改善効果 (全体)	平均価格改善効果 (主市場最良気配価格内)	平均価格改善効果 (その他)
4.63	5.33	-0.08



■ % 主市場最良気配価格内 ■ % その他

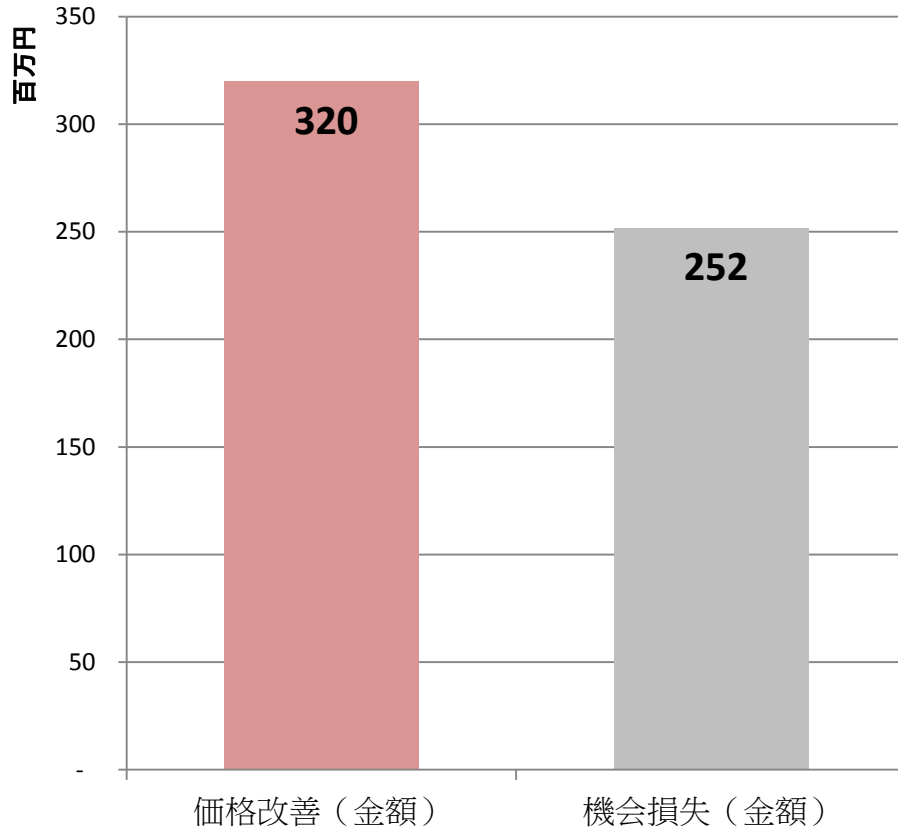


■ % 主市場最良気配価格内 ■ % その他

¹ PI (価格改善効果)は 約定価格と主市場の各売りのベストビットと、もしくは各買いのベストオファーの約定において計算され、取引のテイク側側の視点において計算される。

機会損失

実効果と機会損失分



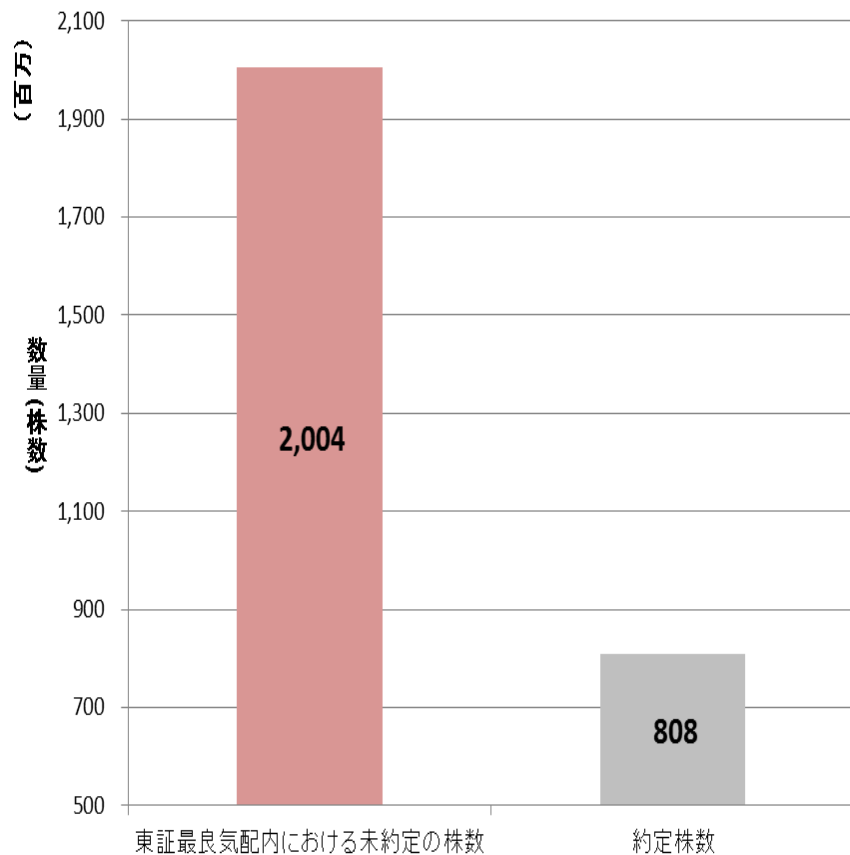
機会損失の大きかった上位10銘柄

銘柄コード	銘柄	機会損失率*
1821	三井住友建設	64.9%
8107	キムラタン	64.8%
3250	エー・ディー・ワークス	60.1%
3103	ユニチカ	57.4%
2768	双日	55.3%
5703	日本軽金属ホールディングス	48.9%
9101	日本郵船	46.9%
6701	日本電気	46.8%
3101	東洋紡	46.6%
7003	三井造船	46.5%

・ 機会損失とは、主市場における約定が、その時のチャイエックスにおける同じサイズ、もしくはそれ以上での指値よりも悪い場合を示しています。

メーカーとしての機会

テイカー注文の約定株数¹と機会損失²



主市場の最良気配内での未約定株数ランキング メーカーとしてのチャンス銘柄

銘柄コード	銘柄名	約定株数 (a)	主市場の最良気配内 にもかかわらず未約定 の株数 (b)	メーカーとして 約定する機会 (b/a)
8411	みずほフィナンシャルグループ	8,510,300	80,153,500	942%
6753	シャープ	22,225,000	71,852,000	323%
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,649,000	49,678,200	1875%
6740	ジャパンディスプレイ	11,434,200	46,159,700	404%
6502	東芝	2,409,000	38,665,000	1605%
9501	東京電力ホールディングス	8,297,600	37,459,000	451%
9101	日本郵船	30,349,000	34,780,000	115%
8303	新生銀行	26,170,000	30,640,000	117%
8604	野村ホールディングス	330,000	29,367,000	8899%
7211	三菱自動車工業	5,830,900	25,520,900	438%

¹テイカーオーダー: IOCもしくはFOKオーダー

²最良価格は主市場における売り(買い)注文に対しより良い、もしくは同等のベストBit(Ask)の有無を参照しています。

大型株株式統計

大型株の総取引高 ¹	82,815,175,300
東証に対するマーケットシェア ²	0.29%
東証の最良気配と同じ、 もしくはそれよりも良い価格で約定した銘柄の平均割合 ³	5.74%

大型株トップ10

銘柄コード	銘柄名	マーケット シェア	平均価格 改善効果	改善分 (金額)	機会損失率	機会損失 (百万円)	増分利益率
1605	国際石油開発帝石	1.02%	1.4	189,530	1.1%	45,790	3.62%
8795	T&Dホールディングス	0.86%	3.4	326,030	0.6%	37,370	4.82%
8830	住友不動産	0.80%	2.9	492,400	0.7%	63,100	2.53%
5713	住友金属鉱山	0.71%	0.8	73,100	0.4%	32,900	5.79%
8630	SOMPOホールディングス	0.70%	1.8	234,190	0.6%	91,700	1.94%
3407	旭化成	0.70%	2.2	173,600	0.6%	38,500	2.61%
4507	塩野義製薬	0.68%	0.7	56,660	1.1%	41,620	4.14%
7201	日産自動車	0.67%	1.1	211,970	3.1%	134,340	2.27%
8031	三井物産	0.67%	1.4	271,780	2.1%	109,880	17.93%
6752	パナソニック	0.63%	1.0	133,700	1.7%	64,670	2.81%

¹大型株とはTOPIX100の大型株式インデックスを含む。

²マーケットシェアは東証の取引売買代金をChi-xの取引売買代金で割り、算出。

³増分利益率は東証の最良気配と同じ、またはそれよりも良い価格でチャイエックスにてついた銘柄のシェアの平均とし、主市場の最良気配での平均株式数に対する割合。

上記はマーケットシェアトップ10の銘柄。⇒以下、中型、小型も同様。

中型株₁株式統計

中型株の総取引高 ¹	587,124,055,050
東証に対するマーケットシェア ²	3.22%
東証の最良気配と同じ、 もしくはそれよりも良い価格で約定した銘柄の平均割合 ³	8.07%

中型株トップ¹⁰

銘柄コード	銘柄名	マーケット シェア	平均価格 改善効果	改善分 (金額)	機会損失率	機会損失 (百万円)	増分利益率
2670	エービーシー・マート	8.65%	5.6	1,612,500	12.5%	584,200	9.33%
4208	宇部興産	8.25%	14.2	4,966,900	45.3%	4,132,700	7.66%
4307	野村総合研究所	8.18%	5.0	1,624,510	13.6%	328,290	7.86%
3088	マツモトキヨシホールディングス	7.80%	4.7	1,059,300	15.1%	665,500	12.06%
6856	堀場製作所	7.57%	5.3	776,930	21.2%	575,170	6.88%
8078	阪和興業	7.57%	4.8	457,400	7.3%	146,500	14.09%
3941	レンゴー	7.49%	5.3	1,026,480	15.0%	278,370	8.15%
4203	住友ベークライト	7.09%	4.8	688,000	10.8%	341,300	13.05%
4581	大正製薬ホールディングス	7.09%	3.8	673,700	6.7%	167,600	11.40%
7276	小糸製作所	7.04%	4.8	1,754,600	14.5%	792,400	10.58%

¹中型株とはTOPIX400の中型株式インデックスを含む。

²マーケットシェアは東証の取引売買代金をChi-xの取引売買代金で割り、算出。

³増分利益率は東証の最良気配と同じ、またはそれよりも良い価格でチャイエクセスにてついた銘柄のシェアの平均とし、東証BBOでの平均株式数に対する割合。
上記はマーケットシェアトップ10の銘柄。

小型株¹ 株式統計

小型株の総取引高 ¹	121,439,489,790
東証に対するマーケットシェア ²	1.93%
東証の最良気配と同じ、 もしくはそれよりも良い価格で約定した銘柄の平均割合 ³	8.68%

小型株トップ10

銘柄コード	銘柄名	マーケットシェア	平均価格改善効果	改善分(金額)	機会損失率	機会損失(百万円)	増分利益率
5741	UACJ	8.02%	9.1	1,516,400	26.3%	1,065,800	8.76%
1861	熊谷組	7.48%	9.7	1,260,200	32.4%	1,081,700	8.27%
8840	大京	7.40%	13.4	882,800	34.2%	754,700	9.11%
3002	グンゼ	7.22%	7.2	225,300	19.8%	226,500	14.01%
3593	ホギメディカル	6.52%	3.3	100,100	7.5%	61,700	13.50%
6997	日本ケミコン	6.25%	10.8	691,400	29.0%	938,200	12.55%
4733	オービックビジネスコンサルタント	6.00%	6.5	92,420	6.0%	32,280	16.66%
5301	東海カーボン	5.81%	6.6	323,300	14.1%	225,700	10.92%
8558	東和銀行	5.76%	27.8	279,600	38.8%	384,000	6.61%
6444	サンデンホールディングス	5.62%	6.3	250,600	14.8%	212,000	9.91%

¹小型株とはTOPIXの小型株式インデックスを含む。

²マーケットシェアは東証の取引売買代金をChi-xの取引売買代金で割り、算出。

³増分利益率は東証の最良気配と同じ、またはそれよりも良い価格でチャイエクセスにてついた銘柄のシェアの平均とし、東証BBOでの平均株式数に対する割合。
上記はマーケットシェアトップ10の銘柄。

売買代金上位10銘柄

銘柄コード	銘柄名	マーケット シェア*	平均価格 改善効果	改善分 (金額)	機会損失率	機会損失 (百万円)	売買代金
4005	住友化学	5.15%	5.7	4,425,200	19.5%	2,810,700	8,256,104,200
9104	商船三井	5.95%	9.3	6,515,100	32.8%	5,392,600	8,219,980,500
6762	T D K	3.73%	3.8	2,856,500	10.5%	1,469,100	7,677,290,100
9101	日本郵船	5.37%	15.0	8,797,500	46.9%	10,417,600	7,299,827,700
6869	シスメックス	6.38%	4.7	3,160,100	15.4%	1,809,400	6,808,152,500
7012	川崎重工業	5.48%	8.7	4,856,600	35.9%	4,885,500	6,735,923,600
4324	電通	4.28%	5.8	3,520,910	15.9%	2,103,010	6,369,304,070
6645	オムロン	6.23%	4.0	2,530,930	11.1%	625,470	6,362,481,230
4689	ヤフー	5.57%	8.2	4,165,670	38.1%	3,170,510	6,138,298,930
8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	12.53%	5.9	3,423,400	25.0%	867,670	6,009,662,920

*マーケットシェアは東証の取引売買代金をChi-xの取引売買代金で割り、算出

© 2017, Chi-X Japan Limited (“Chi-X”). All rights reserved. Chi-X is a registered mark in jurisdictions around the world. Chi-X is a financial instruments trading firm licensed by the Financial Services Agency (FSA) to operate a proprietary trading system. Chi-X has taken care to ensure that the information contained in this publication is correct at the time of going to press, but shall not be liable for decisions made in reliance on it by any reader or anyone who may be informed of its content. It is provided for informational purposes only, and does not constitute an offer, solicitation, or recommendation with respect to the purchase or sale of any security.

Reproduction or redistribution of this information is prohibited except with written permission from Chi-X.

チャイエックス・ジャパン株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第2426号
加入協会 日本証券業協会