



チャイエックス・ジャパン 月次統計レポート

2017年1月

月次統計値と傾向

Chi-X PTS

月間合計売買代金

JPY 625,048,309,823

月間合計売買高

555,693,041

売買代金シェア¹

1.2%

銘柄における売買高シェア¹

1.3%

一日平均売買代金

JPY 32,897,279,464

一日平均売買高

29,247,002

一日平均取引高

96,763

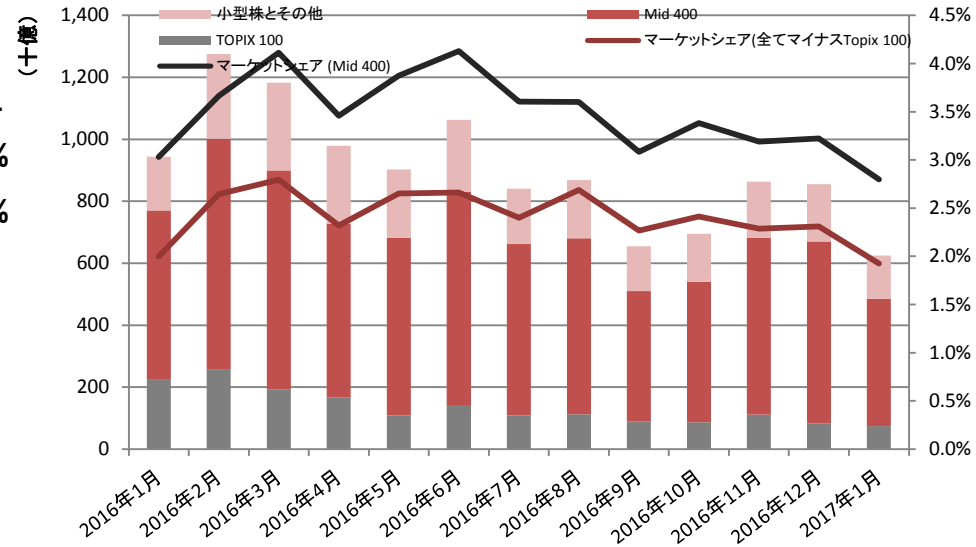
一日平均約定銘柄

1,707

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 48,006,348,330

月間合計売買高

28,974,014

約定件数

9,902

約定銘柄数

847

一日平均注文代金

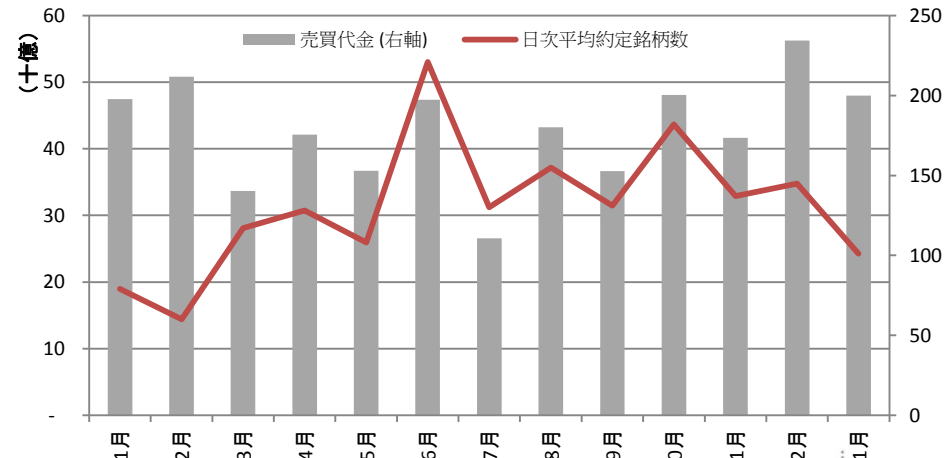
JPY 112,108,930,721

一日平均注文高

81,062,431

一日平均注文数

4,525



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

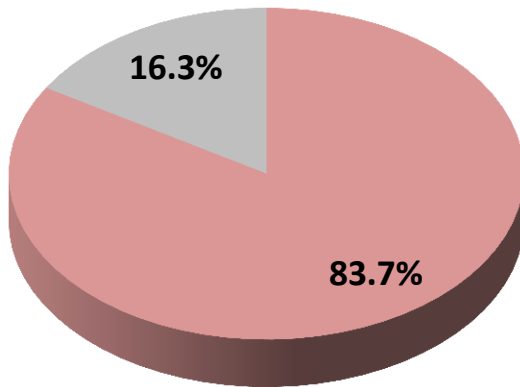
チャイエックスにおける価格改善効果¹

価格改善効果 (全体)

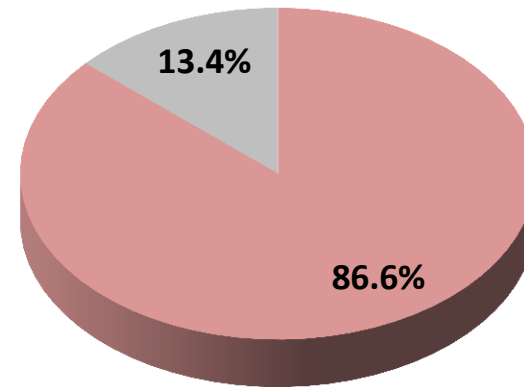
平均価格改善効果 (全体)	平均価格改善効果 (主市場最良気配価格内)	平均価格改善効果 (その他)
3.67	4.49	-0.50

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)
3.95	4.65	-0.08



■ % 主市場最良気配価格内 ■ % その他

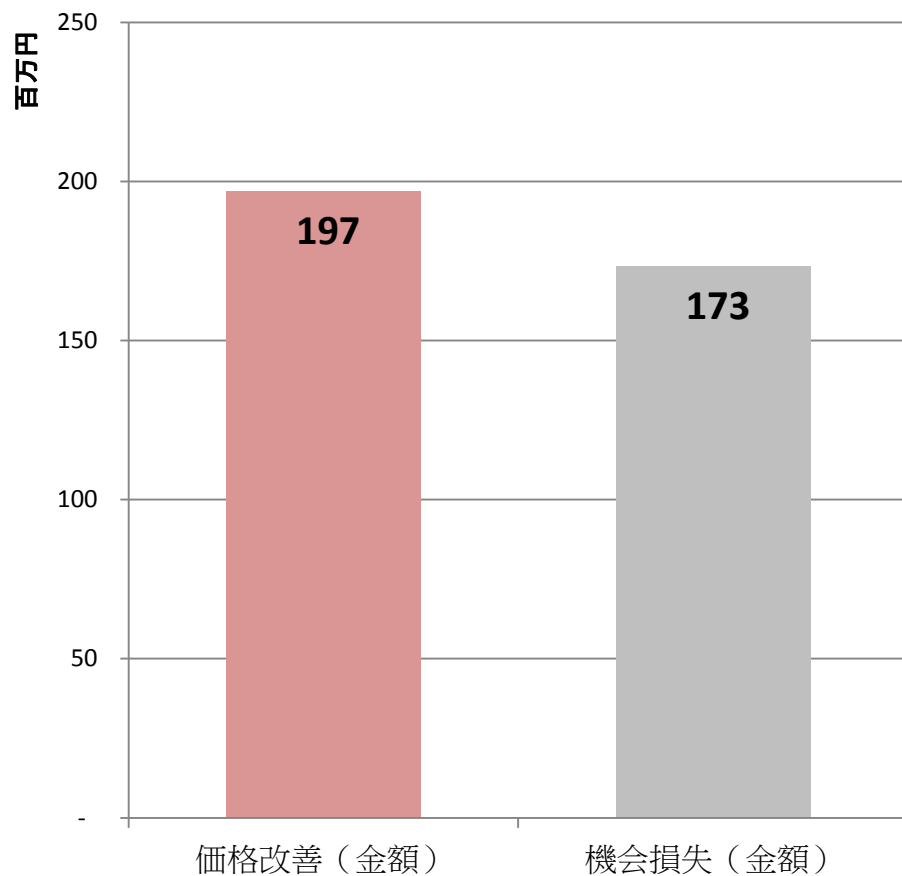


■ % 主市場最良気配価格内 ■ % その他

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



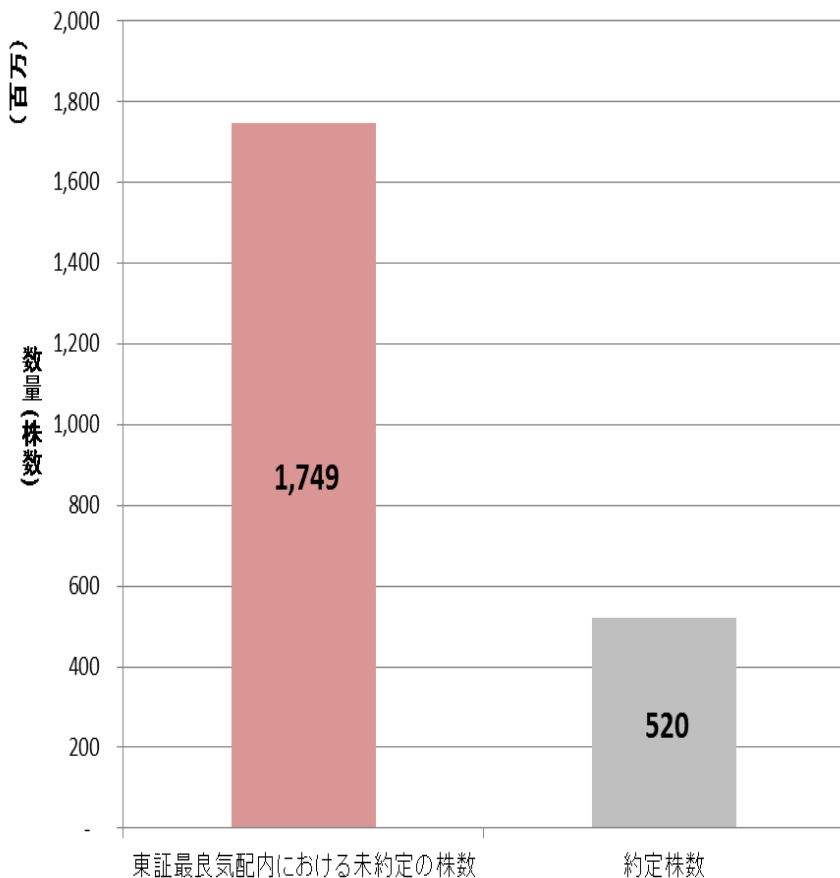
機会損失の大きかった上位10銘柄

銘柄コード	銘柄	機会損失率*
3103	ユニチカ	63.2%
1821	三井住友建設	58.1%
2768	双日	50.0%
3250	エー・ディー・ワークス	48.6%
3101	東洋紡	47.3%
6701	日本電気	45.1%
1805	飛島建設	44.5%
8410	セブン銀行	43.2%
7003	三井造船	43.1%
1514	住石ホールディングス	43.1%

・ 機会損失とは、主市場における約定が、その時のチャイェ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)
6502	東芝	4,480,000	107,860,000	2408%
6753	シャープ	14,880,000	47,555,000	320%
8411	みずほフィナンシャルグループ	5,814,400	47,185,900	812%
9101	日本郵船	12,689,000	33,407,000	263%
3318	メガネスーパー	320,800	32,057,800	9993%
4208	宇部興産	10,442,000	31,893,000	305%
9104	商船三井	12,838,000	31,777,000	248%
6701	日本電気	8,751,000	29,024,000	332%
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,120,100	27,133,600	1280%
6740	ジャパンディスプレイ	5,688,700	19,838,600	349%

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いての売り(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	73,849,192,280
東証に対するマーケットシェア ²	0.32%
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	3.76%

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
8795	T&Dホールディングス	1.04%	1.0	96,340	1.1%	43,960	5.05%
4507	塩野義製薬	1.02%	0.6	68,000	0.3%	33,800	9.21%
5802	住友電気工業	0.87%	0.9	46,310	0.9%	17,830	4.75%
6861	キーエンス	0.82%	2.8	775,800	1.4%	388,200	18.42%
8801	三井不動産	0.78%	1.1	179,700	0.8%	86,500	3.10%
8630	SOMPOホールディングス	0.69%	1.1	62,620	0.9%	20,690	3.17%
7202	いすゞ自動車	0.69%	0.9	37,060	0.8%	14,100	3.88%
7186	コンコルディア・フィナンシャル グループ	0.63%	1.2	36,260	0.3%	10,230	1.92%
8830	住友不動産	0.61%	3.0	259,200	0.7%	33,400	1.97%
8591	オリックス	0.61%	1.0	101,250	1.2%	43,220	3.45%

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	411,860,080,980
東証に対するマーケットシェア ²	2.80%
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	7.63%

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
4768	大塚商会	8.64%	5.2	1,080,000	15.6%	460,500	9.05%
4684	オービック	8.48%	4.4	662,930	15.2%	334,340	10.13%
4544	みらかホールディングス	6.82%	4.4	449,900	14.2%	241,600	9.09%
7988	ニフコ	6.77%	4.6	658,600	12.2%	324,600	5.71%
7649	スギホールディングス	6.55%	4.0	702,900	16.6%	407,400	8.24%
6201	豊田自動織機	6.48%	4.7	1,602,500	12.8%	690,900	7.10%
3088	マツモトキヨシホールディングス	6.40%	4.9	962,000	12.1%	560,700	5.78%
2206	江崎グリコ	6.34%	5.6	1,335,300	17.3%	910,400	6.30%
4555	沢井製薬	6.01%	3.2	508,600	19.7%	514,800	7.47%
4203	住友ベークライト	5.89%	4.4	329,200	6.4%	109,700	8.11%

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	93,565,276,210
東証に対するマーケットシェア ²	1.63%
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	6.76%

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
5344	MARUWA	8.01%	9.6	486,840	8.2%	119,360	45.64%
3002	グンゼ	6.29%	7.0	215,800	14.9%	178,300	8.93%
5741	UACJ	5.79%	6.4	511,400	22.2%	461,500	6.42%
2659	サンエー	5.63%	3.0	88,100	8.8%	65,000	11.51%
7606	ユナイテッドアローズ	5.55%	4.4	415,490	10.7%	149,240	4.62%
6997	日本ケミコン	5.43%	10.7	460,500	16.5%	283,500	6.25%
1861	熊谷組	5.28%	7.4	748,900	30.0%	1,019,100	6.72%
6444	サンデンホールディングス	4.99%	5.9	134,300	11.7%	115,800	6.92%
6908	イリソ電子工業	4.91%	2.1	51,800	4.6%	33,200	16.35%
3632	グリー	4.80%	3.9	173,590	15.9%	91,290	3.76%

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
6963	ローム	5.40%	3.4	1,725,500	10.0%	731,700	5,408,512,700
4324	電通	4.82%	5.8	3,004,900	15.2%	1,472,100	5,406,729,900
4005	住友化学	4.46%	4.7	2,409,500	19.7%	1,807,400	5,340,668,500
6753	シャープ	1.66%	9.2	3,565,700	41.4%	17,047,300	5,099,092,700
4689	ヤフー	5.33%	7.3	2,776,980	33.2%	1,993,790	4,908,079,700
7012	川崎重工業	4.93%	8.2	3,068,800	30.8%	2,841,100	4,742,334,400
9104	商船三井	3.78%	7.9	2,996,500	28.0%	3,545,600	4,704,871,100
6645	オムロン	4.73%	3.5	1,562,580	12.5%	458,980	4,586,773,700
6098	リクルートホールディングス	3.25%	2.7	1,081,930	15.1%	624,530	4,521,511,610
6762	T D K	2.82%	3.4	1,471,500	10.5%	1,029,900	4,423,354,100

*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