

平成12年11月10日  
日 本 銀 行

日銀ネットRTGS化にかかる総合運転試験（フェーズ2）・  
ラウンド1における決済状況について

10月21日（土）および29日（日）に実施したRTGS化（日本銀行当座預金決済・国債決済のRTGS化、与信・担保システムの稼働開始及びオンライン当座預金振替のサービス提供時間延長をいいます。）のRT（総合運転試験をいいます。）<sup>1</sup>フェーズ2・ラウンド1における試験結果の取り纏め、およびRTにおける決済データ<sup>2</sup>の集計計数は次のとおりです。

なお、決済慣行関連のアンケート調査が日本証券業協会・国債決済RTGS化に関する研究会および短期金融市場取引活性化研究会により実施されています。

（RTフェーズ2・ラウンド1の総括）

日本銀行では、今回実施したRTフェーズ2・ラウンド1における決済状況について、参加先の協力を得ながら、実態の把握、問題点の洗い出し等を行ってきました。その結果、概ね以下のように総括することができるものと考えています。

- （1）資金決済については、1日目は約定確認、担保振替等の面で若干の事務遅延が見られたが、2日目は概ね円滑に決済が行われた。
- （2）国債決済については、1日目は概ね円滑に決済が行われたが、2日目（国債発行日を想定したテスト）は決済予定件数が1日目の約3倍に上ったこともあり、テスト特有の原因等からフェイルが相当数発生した。また、決済を処理する時間（ここでは、「相手方から国債受渡依頼の電文を受けてから資金受渡依頼を入力するまでの時間」をもって計測）も事前の想定以上にかかっていた。

<sup>1</sup> RTフェーズ2の概要については、「RTGS化RTフェーズ2の日程等について」（平成12年8月4日）をご参照下さい。

<sup>2</sup> 当座勘定振替時間帯毎決済件数、金額、国債DVP時間帯毎決済件数、金額、および国債DVP決済所要時間（国債受渡依頼の入力から資金受渡依頼の入力までの時間）の3種類のデータを指します。

R Tにおけるフェイルの発生状況等については、日本証券業協会・  
国債決済R T G S化に関する研究会にてアンケート調査の集計、公表が  
行われる予定。

(3) 上記(2)の主たる理由としては、ごく一部の参加先におけるシステ  
ムトラブルの発生<sup>3</sup>、ごく一部の参加先におけるR Tでの使用可能端末台数  
の制約<sup>4</sup>、R T G S化等の下での決済事務に関する事務未習熟(テスト・デー  
タの作成不備を含む)が挙げられる。こうしたテスト特有の原因等で発生し  
たフェイルが連鎖した結果、全体のフェイル発生率が高まった模様。

<事務の習熟度が不十分と考えられる主な事例>

・テストデータの作成不備

決済口座データの相違(自己口、預り口、信託口間の相違)  
既存データの小口化時における端数金額処理の不一致

・事務手順の未習熟

端末入力事務未習熟による事務遅延  
照合事務手順の未習熟による事務遅延  
残高不足状態での国債受渡依頼電文の送信  
国債発行払込み直後における、共通担保口から同時受払担保口へ  
の担保移し替え事務の未習熟による事務遅延  
各種データのダウンロード等手順の未習熟

・その他

各社内および各社間における決済慣行(特にカットオフタイム)  
の運用方針の不徹底

### (次回のR Tに向けて)

日本銀行では、今回本番さながらに事務・システム運行を行ったことで、R  
T G S化への移行に際する問題点を洗い出すことが出来たと評価しています。  
今後、こうした問題点がひとつひとつ解決され、次回以降のラウンドが迎えら  
れることが重要と考えます。

今回洗い出された問題点については、すでに関係する参加先において対応策

---

<sup>3</sup> 参加先のシステムにおける環境設定の不備なども含みます。

<sup>4</sup> 各先とも本番時には必要な端末台数が確保される見込み。

が検討され、様々な手当てが進められています。また別途、日本証券業協会、短期金融市場取引活性化等研究会等においても、慣行面等からの検討が行われています。こうした対応策等の検討に際して、事務、システム対応等の面で私どもにご照会、ご相談がありましたら何なりとお寄せ頂きたいと考えています。

日本銀行では、こうした参加先における着実な対応が進められることにより、ラウンドを重ねるごとに円滑な決済が行われるようになるものと期待しています。私どもとしても、来年1月4日の円滑なRTGSへの移行を実現できるよう、引き続き着実に準備を進めていく考えです。

**(本件全般に関する照会先)**

日本銀行信用機構室 浅田

TEL 03-3277-1137

E-mail tooru.asada@boj.or.jp

日本銀行金融市場局 加藤(毅)

TEL 03-3277-1286

E-mail takeshi.katou@boj.or.jp

**(参考計数に関する照会先)**

日本銀行信用機構室 中村

TEL 03-3277-2147

E-mail takeshi.nakamura-1@boj.or.jp

金融市場局金融市場課 <sup>カサイ</sup>河西

TEL 03-3277-1286

E-mail makoto.kasai@boj.or.jp

以 上

日銀ネットRTGS化等にかかる総合運転試験（フェーズ2）の結果について

第1ラウンド（10/21日、10/29日）分

1．試験結果報告書の集計結果（回収率：第1日目 95%、第2日目 92%）

（1）事前に準備した取引の決済を全て行ったか。

（第1日目＜10/21日＞）

行った先 : 87% 行えなかった先 : 13%

（第2日目＜10/29日＞）

行った先 : 69% 行えなかった先 : 31%

<実施できなかった取引とその理由（例）>

取引の種類	主な理由
国債売買	<ul style="list-style-type: none"> <li>・相手方の国債残高不足</li> <li>・相手方の資金受渡依頼未入力</li> <li>・自社の事前準備不備（決済データの不備等）</li> <li>・自社のシステムトラブル</li> <li>・相手方と合意のうえ決済を取り止め</li> <li>・相手方より第2日目（国債発行日）において16:00をもってフェイルにしたいとの申し出</li> <li>・相手方からの国債受渡依頼電文の遅れ</li> </ul>
コール取引	<ul style="list-style-type: none"> <li>・自社システムの操作誤入力</li> <li>・有担コール取引における担保残高の不一致</li> </ul>

（2）対日銀取引の決済を全て行ったか。

（第1日目＜10/21日＞）

行った先 : 96% 行えなかった先 : 4%

（第2日目＜10/29日＞）

行った先 : 98% 行えなかった先 : 2%

<実施できなかった取引とその理由（例）>

取引の種類	主な理由
国債発行関係事務	<ul style="list-style-type: none"> <li>・自社の事前準備不足（入力データ作成漏れ等）</li> <li>・残高管理ミス</li> </ul>
海預取引	<ul style="list-style-type: none"> <li>・残高管理ミス</li> </ul>

( 3 ) 1日の決済事務フローを円滑に行ったか。

( 第 1 日目 < 10/21 日 > )

行った先 : 80% 行えなかった先 : 20%

( 第 2 日目 < 10/29 日 > )

行った先 : 79% 行えなかった先 : 21%

< 実施できなかった事務とその理由 ( 例 ) >

事務	主な理由
コール取引の約定から決済までの迅速化	<ul style="list-style-type: none"><li>・短資約確システムを用いた約定確認の遅れ</li><li>・有担コール取引における担保振替処理の遅れ</li><li>・相手方の入力ミス</li></ul>
ネットィング取引	<ul style="list-style-type: none"><li>・自社のシステムエラー</li></ul>
当座勘定 ( 同時担保受払時決済口 ) 残高および担保 ( 同時受払 ) 現在高を入力締切時刻までにゼロにする事務	<ul style="list-style-type: none"><li>・対応手順の事前準備不足・不慣れ</li><li>・自社のシステムトラブル</li><li>・相手方からの国債受渡依頼電文の遅延</li><li>・国債決済の遅延による時間不足</li><li>・残高管理ミス</li></ul>
コール返金 ( 10 時迄の完了 )	<ul style="list-style-type: none"><li>・相手方の対応の遅れ</li></ul>
自社システムと日銀ネットとの残高照合	<ul style="list-style-type: none"><li>・フェイル処理等の遅延</li></ul>
国債決済の迅速な処理 ( 12 時迄に概ね終了 )	<ul style="list-style-type: none"><li>・相手方の事務処理の遅延</li></ul>
フェイルにかかる渡し方・受け方間の確認	<ul style="list-style-type: none"><li>・新発債取引の事務処理にかかる遅延</li><li>・相手方との確認作業の未実施</li></ul>

2. 当座勘定（振替）時間帯毎決済件数・金額

(1) 10/21日（土）実施<システム環境日付7/19日>分

件、億円

	9:00-9:10	9:10-9:20	9:20-9:30	9:30-9:40	9:40-9:50	9:50-10:00	10:00-10:30	10:30-11:00	11:00-11:30	11:30-12:00	12:00-13:00	13:00-14:00	14:00-15:00	15:00-16:00	16:00-17:30	合計
件数	761	476	325	288	200	201	456	522	293	281	422	366	303	128	69	5,091
金額	267,806	363,982	107,061	79,711	34,341	28,889	110,287	53,181	53,466	76,431	83,729	83,125	77,155	97,533	38,202	1,554,899

(2) 10/29日（日）実施<システム環境日付7/21日>分

件、億円

	9:00-9:10	9:10-9:20	9:20-9:30	9:30-9:40	9:40-9:50	9:50-10:00	10:00-10:30	10:30-11:00	11:00-11:30	11:30-12:00	12:00-13:00	13:00-14:00	14:00-15:00	15:00-16:00	16:00-17:30	合計
件数	1,306	520	330	370	218	266	573	532	698	288	312	457	355	175	103	6,503
金額	118,516	72,504	40,355	15,498	29,337	52,752	99,474	64,452	59,155	26,323	38,368	75,753	82,798	112,343	100,357	987,982

3. 国債DVP時間帯毎決済件数・金額

(1) 10/21日（土）実施<システム環境日付7/19日>分

件、億円

	9:00-9:30	9:30-10:00	10:00-10:30	10:30-11:00	11:00-11:30	11:30-12:00	12:00-12:30	12:30-13:00	13:00-13:30	13:30-14:00	14:00-14:30	14:30-15:00	15:00-15:30	15:30-16:00	16:00-16:30	合計
件数	409	739	813	662	723	594	453	244	171	198	227	201	106	87	39	5,666
金額	14,625	18,475	23,904	18,895	17,099	20,023	14,326	5,947	5,617	7,240	9,352	7,638	3,607	2,817	1,376	170,944

(2) 10/29日（日）実施<システム環境日付7/21日>分

件、億円

	9:00-9:30	9:30-10:00	10:00-10:30	10:30-11:00	11:00-11:30	11:30-12:00	12:00-12:30	12:30-13:00	13:00-13:30	13:30-14:00	14:00-14:30	14:30-15:00	15:00-15:30	15:30-16:00	16:00-16:30	16:30-17:00	合計
件数	834	1,905	2,190	1,260	1,225	1,138	759	617	730	595	303	230	394	909	836	416	14,341
金額	22,358	55,570	59,763	37,573	37,018	30,024	20,101	22,123	20,617	16,126	9,308	7,577	13,832	20,100	19,128	10,036	401,254

4 . 国債決済所要時間統計

( 1 ) 10/21日 ( 土 ) 実施 < システム環境日付7/19日 > 分

平均 : 38.1分

所要時間	件数	累計	所要時間	件数	累計
1～2分以内	338	354	15～20分以内	384	3,245
2～3分以内	500	854	20～25分以内	231	3,476
3～4分以内	419	1,273	25～30分以内	214	3,690
4～5分以内	286	1,559	30～35分以内	205	3,895
5～6分以内	303	1,862	35～40分以内	177	4,072
6～7分以内	187	2,049	40～45分以内	172	4,244
7～8分以内	107	2,156	45～50分以内	153	4,397
8～9分以内	93	2,249	50～55分以内	91	4,488
9～10分以内	115	2,364	55～1時間以内	71	4,559
			1時間超	1,106	5,665

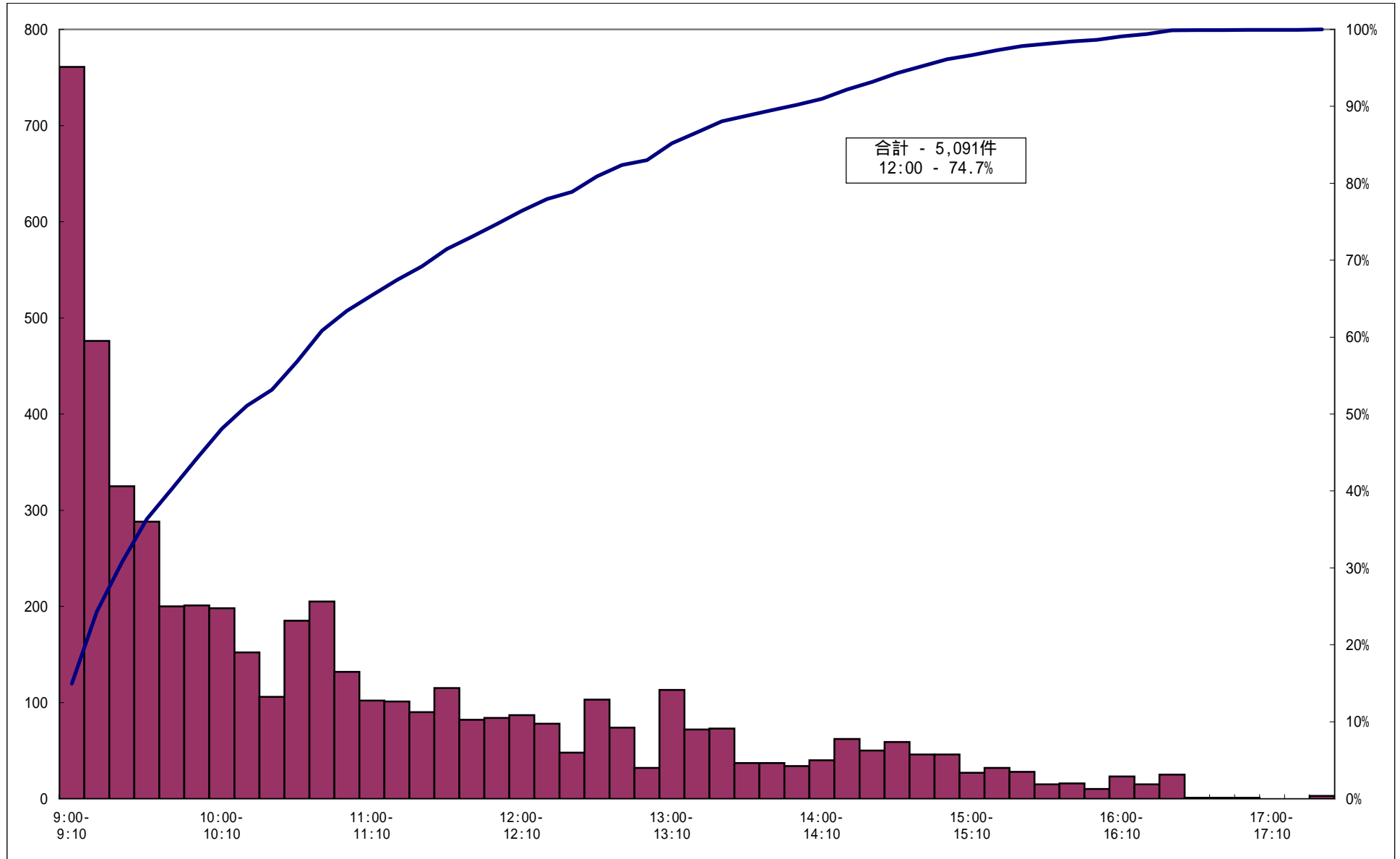
( 2 ) 10/29日 ( 日 ) 実施 < システム環境日付7/21日 > 分

平均 : 37.1分

所要時間	件数	累計	所要時間	件数	累計
1～2分以内	675	704	15～20分以内	734	8,074
2～3分以内	1,220	1,924	20～25分以内	740	8,814
3～4分以内	1,069	2,993	25～30分以内	823	9,637
4～5分以内	849	3,842	30～35分以内	586	10,223
5～6分以内	794	4,636	35～40分以内	542	10,765
6～7分以内	589	5,225	40～45分以内	331	11,096
7～8分以内	463	5,688	45～50分以内	366	11,462
8～9分以内	294	5,982	50～55分以内	238	11,700
9～10分以内	263	6,245	55～1時間以内	193	11,893
			1時間超	2,458	14,351

# 当座勘定（振替）時間帯毎決済件数

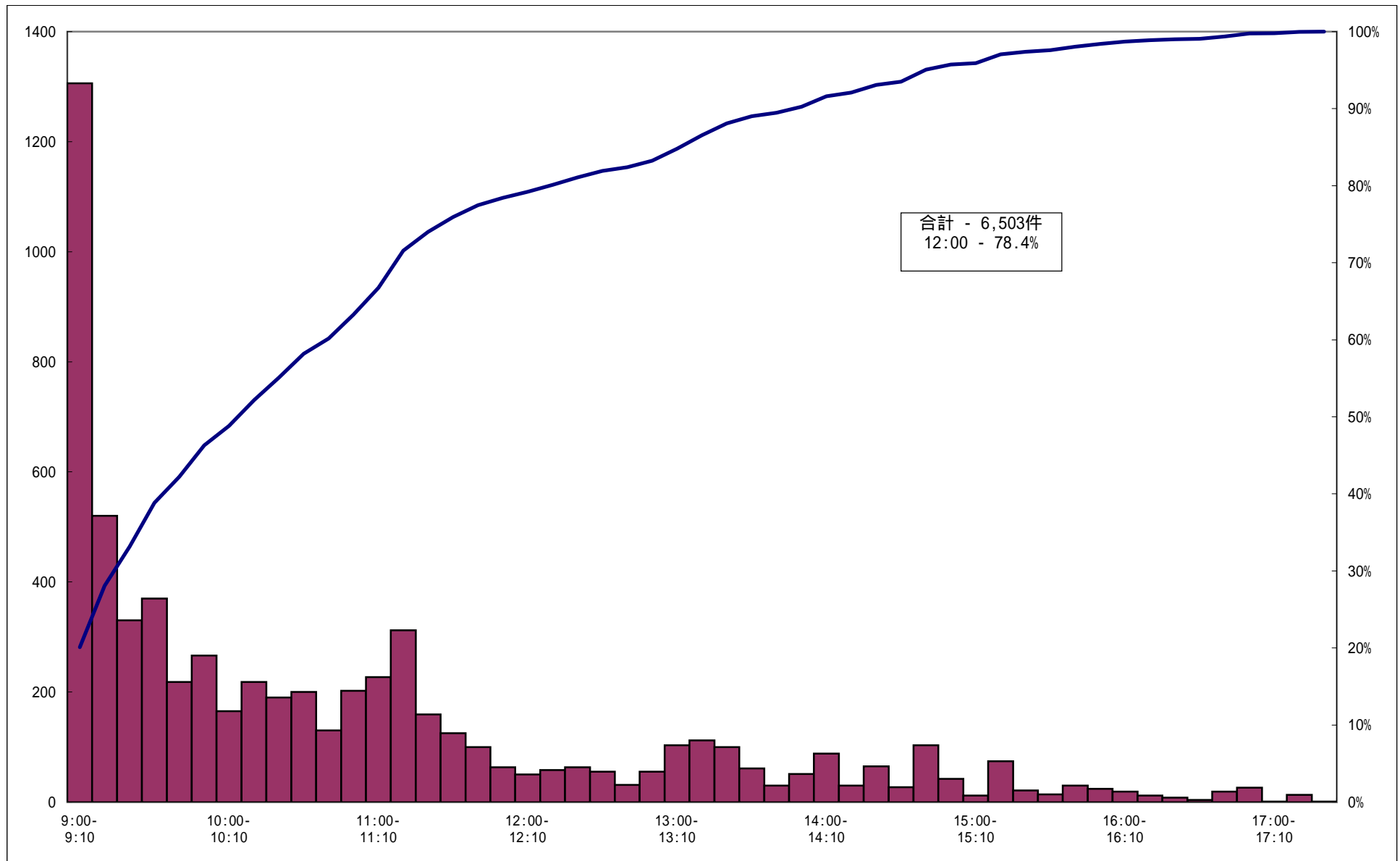
10月21日（土）実施分





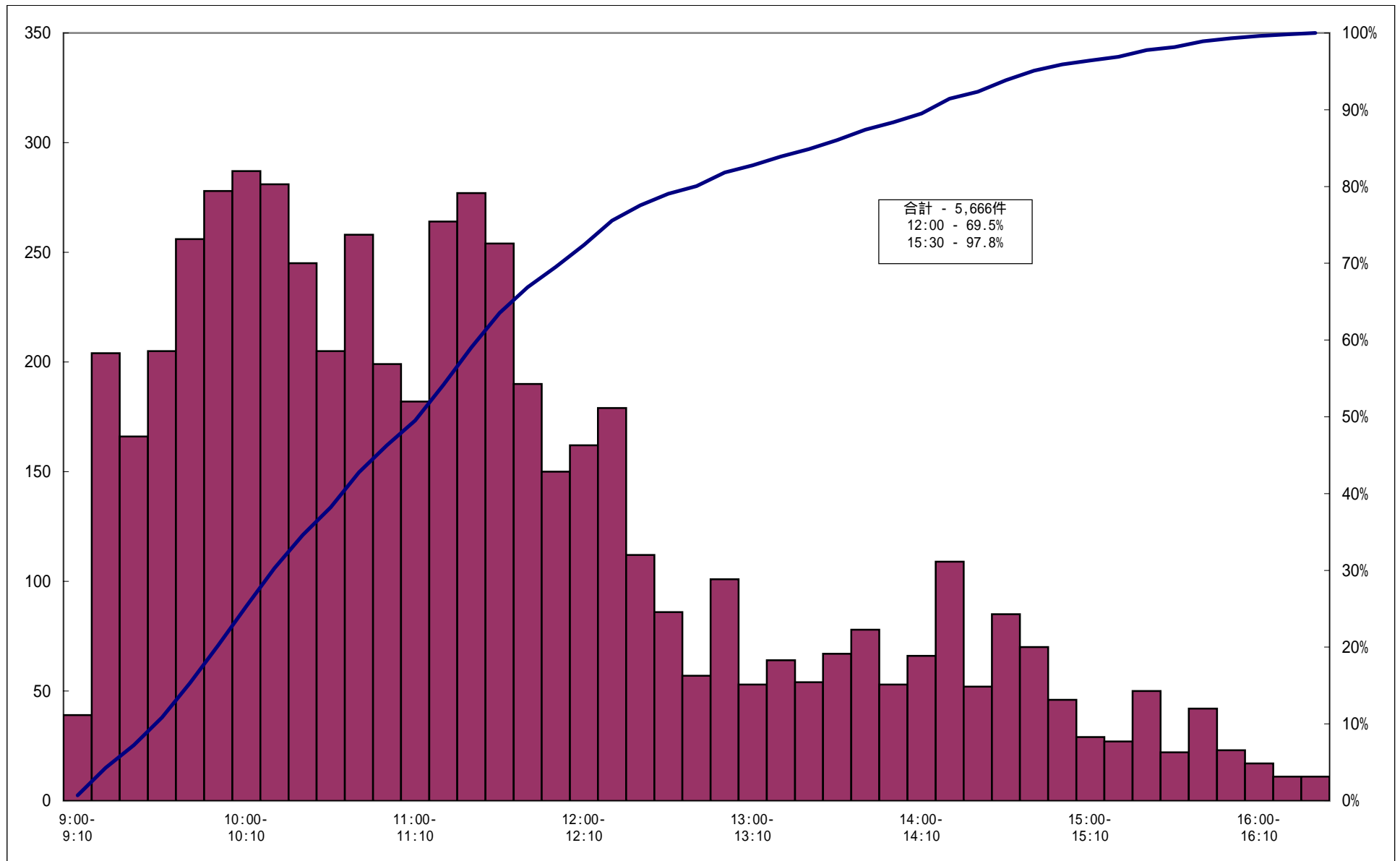
# 当座勘定（振替）時間帯毎決済件数

10月29日（日）実施分



# 国債D V P時間帯毎決済件数

10月21日(土)実施分



# 国債DVP時間帯毎決済件数

10月29日実施分

