

平成12年11月29日

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

今月11日（土）および18日（土）に実施したRTGS化等¹の総合運転試験（以下「RT」といいます。）フェーズ2・ラウンド2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²の集計結果は次のとおりです³。

（RTフェーズ2・ラウンド2の総括）

日本銀行では、ラウンド2における決済状況は、概ね以下のように総括できるものと考えています。

- （1）全体としては、各参加先における事務・システム面での整備が進捗したほか、市場慣行面での対応が図られたことで、ラウンド1で洗い出された課題は解消に向かっており、RTGS化に向けた準備は着実に進んでいることが確認された。
- （2）対日銀取引（オペ等）は、予定していたすべての決済が円滑に行われた。
- （3）資金決済については、第1日目、第2日目とも概ね円滑に決済が行われた。
- （4）国債決済についても、第1日目（通常日を想定したテスト）、第2日目（国債発行日を想定したテスト）とも、ラウンド1に比べ決済の円滑さが大幅に改善した。

¹ 日本銀行当座預金決済のRTGS化、オンライン当座預金振替のサービス提供時間延長、国債決済のRTGS化および与信・担保システムを総称します。

² 当座勘定振替時間帯毎決済件数、金額、国債DVP時間帯毎・銘柄毎決済件数、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。

³ 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の集計結果は、「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」（平成12年11月10日）をご参照下さい（日本銀行のウェブサイト＜<http://www.boj.or.jp/>>から入手可能です。）。

国債決済の時間帯別決済件数をみると、既発債は朝方から、また新発債は午後 3 時から、ラウンド 1 に比べ短時間のうちに急ピッチで決済が進捗した。

国債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）の平均値は、ラウンド 1 のほぼ半分まで改善された。

こうした結果、ラウンド 1 で相当数発生した「国債決済の不処理」も大幅に減少し、国債決済処理比率（決済予定件数に占める実際に決済された件数の割合＜推計＞）は、ラウンド 1 対比大幅に上昇した。ラウンド 2 における決済処理比率は、第 1 日目で 99% 程度、第 2 日目には 97～98% となったとみられる。

RT における「国債決済の不処理」には、RT に参加していない先の絡む取引に起因するもの（テスト特有のもの）が含まれます。また、そもそもループ取引⁴に起因するもの等、RTGS 移行後の本番においても「国債決済の不処理」はある程度残存するとみられます。したがって、上記国債決済処理比率は 100% に達するものではない点（本番移行後も「不処理」が皆無となるとは考えにくい点）にご留意下さい。

（５）RTGS 化後における取引ニーズを展望して、日中コール取引や当日スタートのレポ取引（即日レポ取引）等の約定・決済を、参加者間で試行的に行う事例が見受けられた。日本銀行としても、RTGS への円滑な移行に向けて、より多くの参加先が RT の場を利用してこうした取組みを行っていくことを期待している。

上記のように、ラウンド 2 においては、各参加先のシステム・事務両面にわたる着実な対応の結果、決済の流れは大幅な改善を示しました。参加先において、残された RT などを活用しながら、引続き着実な対応が図られることを期待しています。日本銀行としても、来年 1 月 4 日の円滑な RTGS への移行を実現できるよう、引続き着実に準備を進めていく考えです。

⁴ 例えば、同じ銘柄の国債の取引が、A 金融機関から B 金融機関、B 金融機関から C 金融機関、C 金融機関から A 金融機関といったかたちで一回りしている状態。

(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

(別添資料に関する照会先)

日本銀行信用機構室 中村

TEL 03-3277-2147

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

日本銀行金融市場局 ^{カサイ} 河西

TEL 03-3277-1286

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

以 上

(別 添)

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2ラウンド（11/11日、11/18日）分

1．RTフェーズ2における国債決済処理比率*（推計値）の推移

* 国債決済処理比率＝実際に実行された決済件数／決済予定件数

	通常日	国債発行日
ラウンド1	(10/21日) 94～95%	(10/29日) 82～86%
ラウンド2	(11/11日) 99%程度	(11/18日) 97～98%

(注) 1．計数はRTフェーズ2において日銀ネットが取得した決済データ、および参加先から回収した試験結果報告書などを用いて推計。

2．分母となる決済予定件数には、ループ取引や、テスト不参加先に絡む取引を含むため、決済処理比率は100%に達するものではない点にご留意下さい。

2. 試験結果報告書の集計結果（回収率：第1日目 92%、第2日目 91%）

決済事務フローを円滑に実施できなかった、あるいは事前に準備した取引の決済を全ては実施できなかった理由

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"> ・有担コール取引における担保振替処理の遅れ ・相手方の事務未習熟 ・相手方のシステムトラブル
コール返金（10時迄の完了）	<ul style="list-style-type: none"> ・事務未習熟による処理遅延
ネットティング	<ul style="list-style-type: none"> ・相手方の事務未習熟
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"> ・対応手順の未習熟 ・自社のシステムトラブル ・相手方からの国債受渡依頼電文の遅延 ・国債決済の遅延による時間不足 ・残高管理ミス
国債決済の迅速化（12時迄に概ね終了）	<ul style="list-style-type: none"> ・相手方の事務処理の遅延 ・残高不足状態での国債受渡依頼電文の送信 ・資金受渡依頼入力遅延
国債決済の処理	<ul style="list-style-type: none"> ・相手方の国債残高不足 ・ループ取引 ・相手方のテスト不参加 ・相手方と合意のうえ決済を取り止め ・決済時間の不足(新発債) ・相手方の事前準備不備（データ確認のミス等） ・自社の事前準備不備（国債受渡依頼電文の漏れ等）
国債決済不処理にかかる渡し方・受け方間の確認	<ul style="list-style-type: none"> ・新発債取引の事務処理にかかる遅延 ・カットオフタイムの運用方針の不徹底

1日の決済事務フローを円滑に行ったか（アンケート回答先に占める構成比）

（第1日目＜11/11日＞）

「行った」と回答した先：96% 「行えなかった」と回答した先：4%

（参考：前回第1日目（10/21日））

「行った」と回答した先 80% 「行えなかった」と回答した先 20%

（第2日目＜11/18日＞）

「行った」と回答した先：88% 「行えなかった」と回答した先：12%

（参考：前回第2日目（10/29日））

「行った」と回答した先 79% 「行えなかった」と回答した先 21%

3．当座勘定（振替）時間帯毎決済件数・金額

（１）11/11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	803	690	246	283	186	240	502	618	509	276	385	430	321	163	33	5,685
金額	407,647	250,161	50,630	67,330	72,218	28,144	83,101	34,448	69,949	36,395	45,350	105,148	94,134	168,608	61,086	1,574,348

（２）11/18日（土）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	1,375	572	399	331	220	323	824	514	647	349	467	621	446	280	83	7,451
金額	166,504	111,807	90,059	27,428	23,922	41,153	144,277	63,841	89,910	65,953	68,210	145,121	92,056	130,684	113,254	1,374,177

4．国債ＤＶＰ時間帯毎決済件数・金額

（１）11/11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	873	1,588	1,396	954	388	279	144	71	78	80	35	15	18	12	1	5,932
金額	25,991	43,368	39,481	24,459	14,787	9,643	4,279	1,899	4,492	2,532	1,818	488	516	249	10	174,013

（２）11/18日（土）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	1,198	2,414	2,210	1,680	1,368	1,278	906	720	543	510	193	96	880	1,389	553	78	16,016
金額	29,006	60,739	62,015	49,479	37,269	39,870	29,116	19,680	17,114	11,907	6,722	3,859	19,202	29,002	11,974	1,257	428,211

5 . 国債決済所要時間統計

(1) 11/11日 (土) 実施 < システム環境日付7/19日 > 分

平均 : 17.9分 < 参考 : 10/21日 (土) 実施分・平均38.1分 >

所要時間	件数		所要時間	件数	
		累計			累計
0～1分以内	7	7	10～15分以内	581	3,672
1～2分以内	365	372	15～20分以内	556	4,228
2～3分以内	659	1,031	20～25分以内	372	4,600
3～4分以内	640	1,671	25～30分以内	285	4,885
4～5分以内	440	2,111	30～35分以内	226	5,111
5～6分以内	338	2,449	35～40分以内	124	5,235
6～7分以内	214	2,663	40～45分以内	137	5,372
7～8分以内	200	2,863	45～50分以内	125	5,497
8～9分以内	142	3,005	50～55分以内	69	5,566
9～10分以内	86	3,091	55～1時間以内	59	5,625
			1時間超	308	5,933

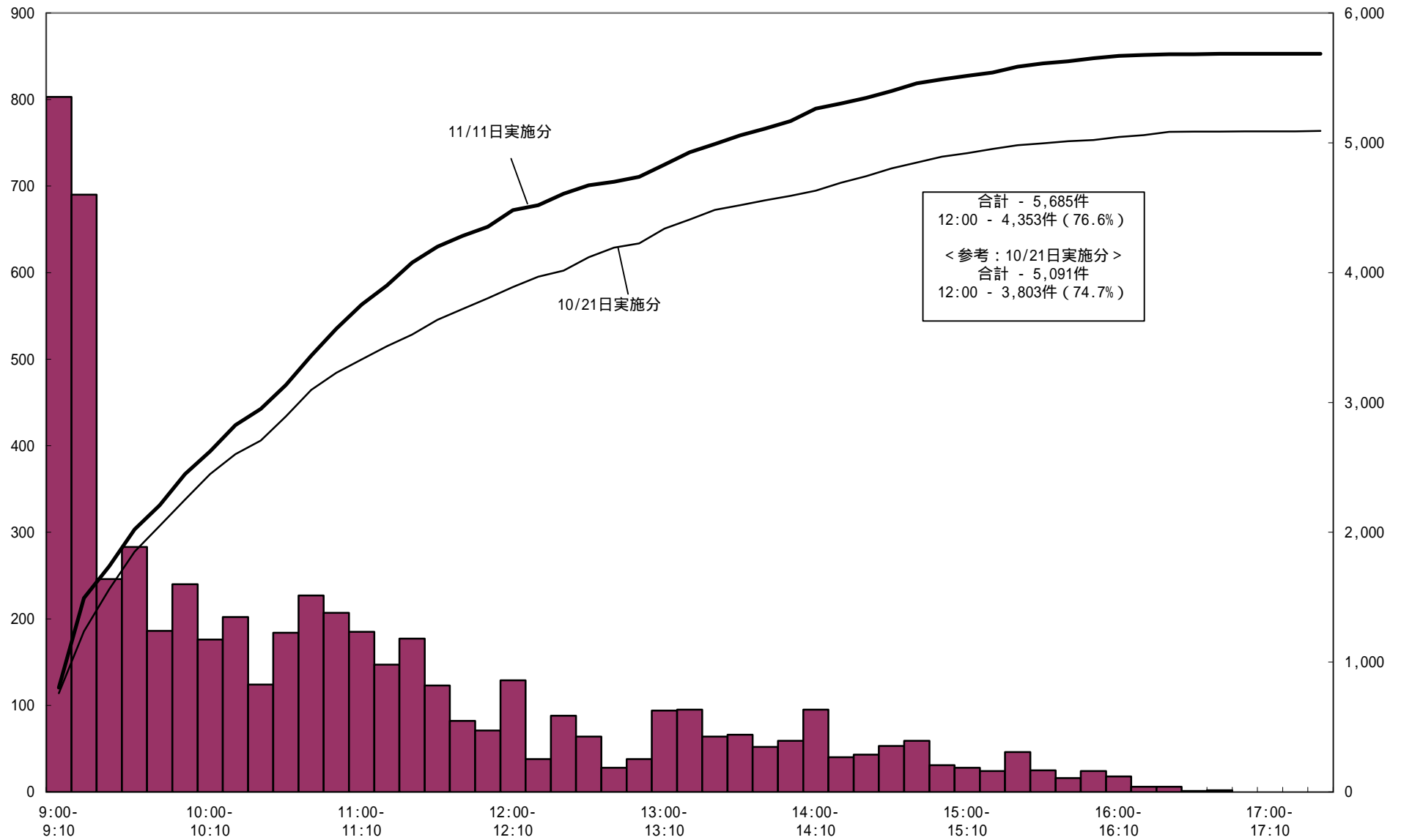
(2) 11/18日 (土) 実施 < システム環境日付7/21日 > 分

平均 : 20.2分 < 参考 : 10/29日 (日) 実施分・平均37.1分 >

所要時間	件数		所要時間	件数	
		累計			累計
0～1分以内	15	15	10～15分以内	1,461	10,299
1～2分以内	621	636	15～20分以内	979	11,278
2～3分以内	1,662	2,298	20～25分以内	763	12,041
3～4分以内	1,709	4,007	25～30分以内	649	12,690
4～5分以内	1,472	5,479	30～35分以内	502	13,192
5～6分以内	1,147	6,626	35～40分以内	382	13,574
6～7分以内	668	7,294	40～45分以内	292	13,866
7～8分以内	544	7,838	45～50分以内	241	14,107
8～9分以内	546	8,384	50～55分以内	225	14,332
9～10分以内	454	8,838	55～1時間以内	147	14,479
			1時間超	1,545	16,024

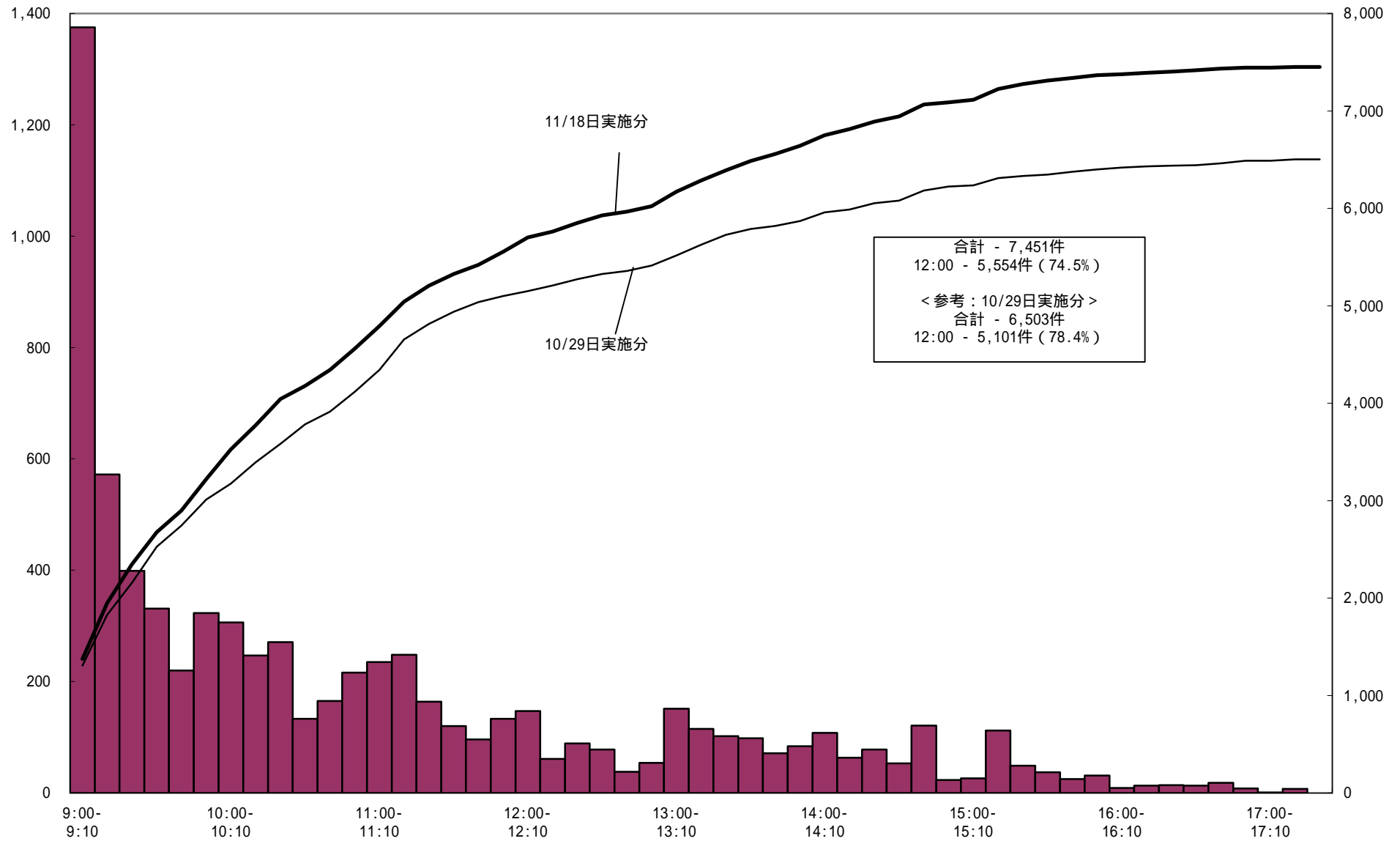
当座勘定（振替）時間帯毎決済件数

11月11日（土）実施分



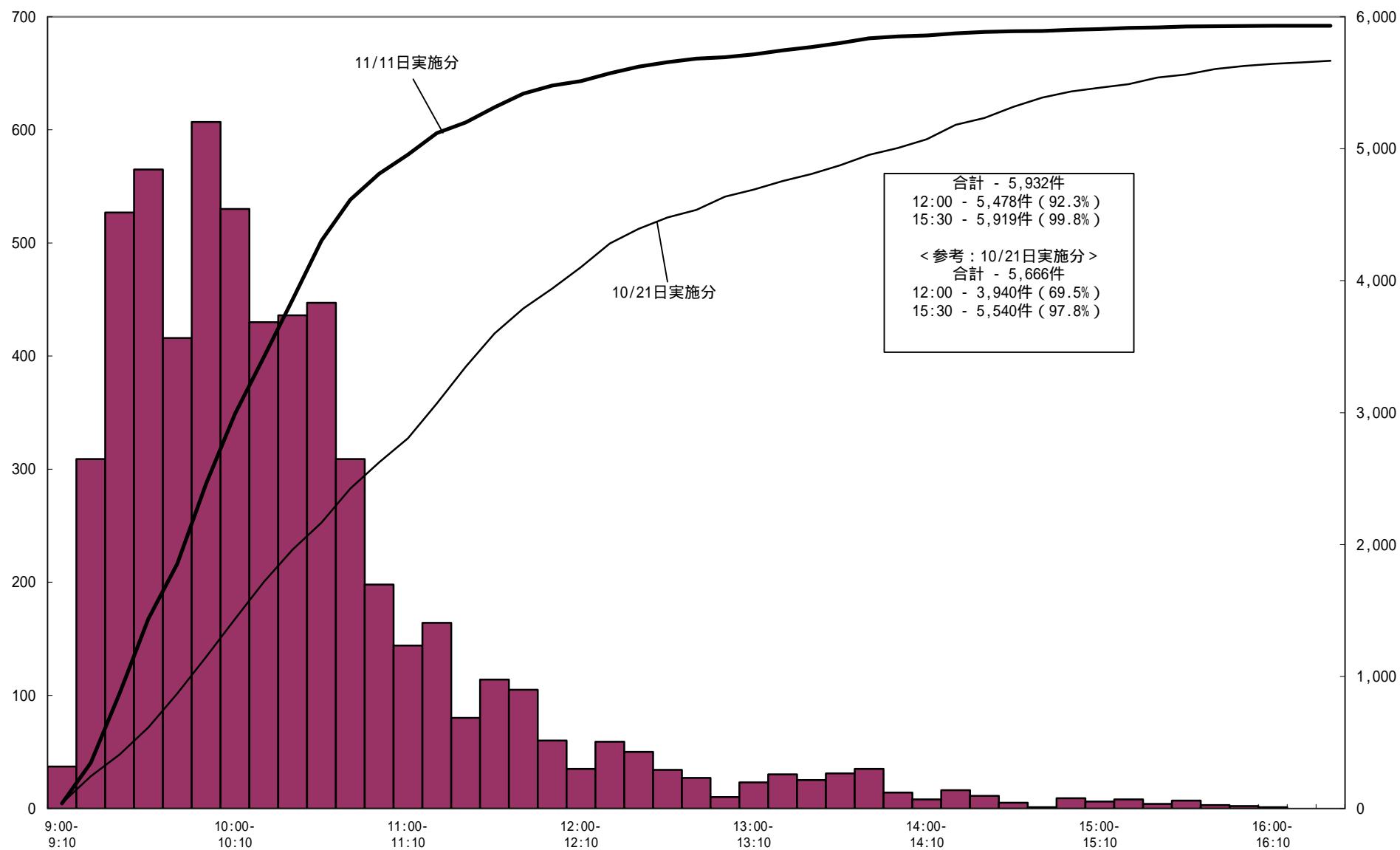
当座勘定（振替）時間帯毎決済件数

11月18日（土）実施分



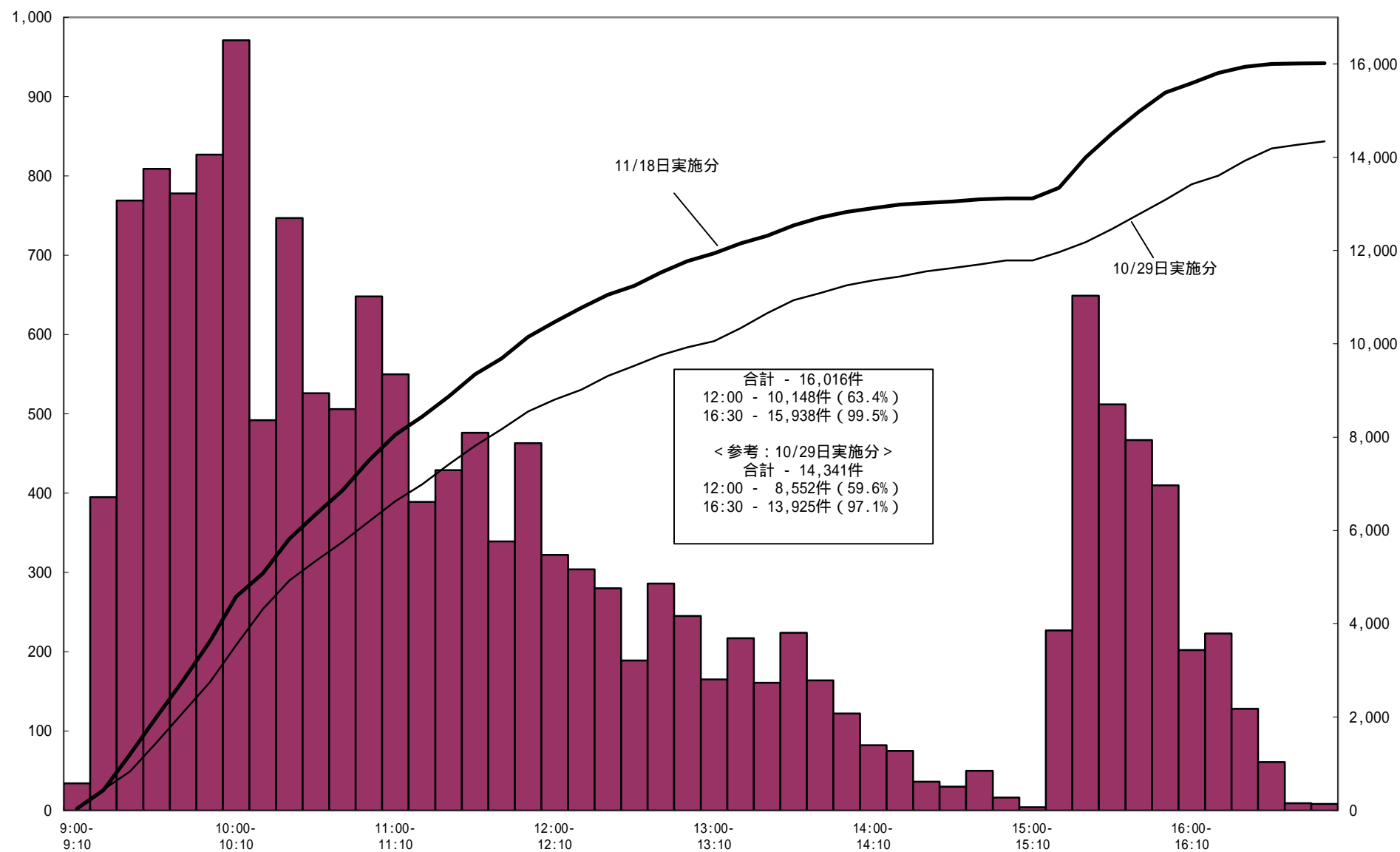
振込国債 D V P 時間帯毎決済件数

11月11日(土)実施分



振込国債 D V P 時間帯毎決済件数

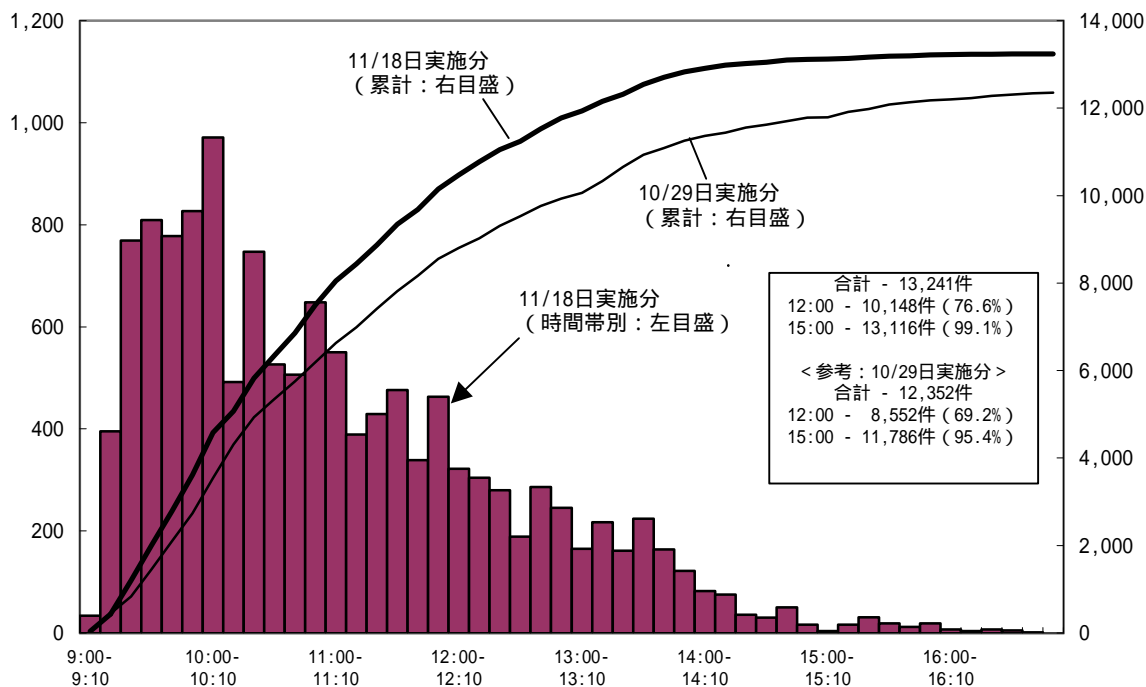
11月18日(土)実施分



既発債・新発債のD V P時間帯別決済件数

(ラウンド2・第2日目<11/18日実施>)

既発債 (ラウンド2・第2日目<11/18日実施>)



新発債 (ラウンド2・第2日目<11/18日実施>)

