

平成12年12月11日
日 本 銀 行

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3における決済状況および日銀ネット国債系の稼働時間
等について

今月2日（土）および3日（日）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3における試験結果の取り纏め、決済データ²の集計結果、および日銀ネット国債系の稼働時間の検討状況は次のとおりです³。

（RTフェーズ2・ラウンド3の総括）

日本銀行では、ラウンド3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おります。

- （1）全体としては、各参加先における事務・システム面や市場参加者における市場慣行面での整備が一段と進捗したことが確認され、来年1月4日に予定するRTGS化の実施に向けた準備はほぼ整ったものとみられる。
- （2）RTGS化後を展望した日中コールや当日スタートのレポ（即日レポ取引）などの取引も前回以上に活発に行われ、新しい取引の仕方や約定から決済までの手順についての確認等も進んでいる。
- （3）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。

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・担保システムの稼働開始を総称します。

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 「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1における決済状況について」（平成12年11月10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」（平成12年11月29日）をご参照下さい（日本銀行ホームページ<<http://www.boj.or.jp/>>の決済システムコーナーに掲載されています。）。

(4) 資金決済については、第1日目、第2日目とも、円滑に決済が行われた。

(5) 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、順調に決済が進捗した。

国債決済を処理する時間⁴は、ラウンド2に比べさらに改善した。

国債決済の時間帯別決済件数をみても、早い時間帯(既発債 = 午前中、新発債 = 午後3時過ぎ)での決済進捗率が一段と高まっている。

国債決済処理比率⁵も、高水準のラウンド2をさらに上回った(第1日目99%台、第2日目98~99%)。

RTの「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、ループ取引⁶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。

(日銀ネット国債系の稼働時間について)

日本銀行では、すでに公表したとおり⁷、これまでのRTの結果等を踏まえ、国債発行日における日銀ネット国債系の稼働時間の延長を検討しています。以下、現時点での日本銀行における検討状況をお伝えします。

利付国債の発行日については、日銀ネット国債系の稼働時間を午後6時まで延長して実施した今回のRT第2日目において、新発債取引の決済が時間的に余裕をもって行われ、参加先からもこれを評価する声が多数聞かれたことなど

⁴ 「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。

⁵ 決済予定件数に占める実際に決済された件数の割合<日銀ネットが取得したデータや参加先からの試験結果報告書などをもとにした推計値>。

⁶ 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。

⁷ 最近の検討状況については「国債決済 RTGS 化に伴う日銀ネット国債系稼働時間延長幅の拡大 関係者のご意見を踏まえて 」(平成12年10月17日)、「日銀ネットRTGS化等総合運転試験(フェーズ2)の追加実施、および今後の試験における日銀ネット稼働時間の延長について」(平成12年11月20日)をご参照下さい。

を踏まえ、すでに公表したとおり、日銀ネット国債系の稼働時間を午後 6 時までとする方向で検討を進めています。

一方、利付国債以外の国債（割引国債、割引短期国債および政府短期証券）のみの発行日については、市場参加者（国債決済 R T G S 化に関する研究会＜事務局・日本証券業協会＞）から、市場慣行であるカットオフタイム以降、日銀ネット国債系入力締切時刻までの時間帯（いわゆるリバーサルタイム）を、通常日や利付国債発行日と同様に 1 時間確保するため、日銀ネット国債系の稼働時間を 30 分延長してほしいとの要望が寄せられています（従来の稼働時間案のもとでは、割引短期国債および政府短期証券のみの発行日におけるリバーサルタイムは、日銀ネット国債系の稼働時間が午後 5 時までであることを前提に、4 時半～5 時までの 30 分間）。こうした要望を踏まえ、日本銀行では、利付国債以外の国債（割引国債、割引短期国債および政府短期証券）のみの発行日については、日銀ネット国債系の稼働時間を午後 5 時 30 分までとする方向で検討を進めています。

以上をまとめると、現在検討している日銀ネット国債系の稼働時間は下表のとおりとなります⁸。日本銀行では、近日中に日銀ネット国債系の稼働時間の最終的な決定を行い、改めて公表する予定です。

< 現在検討中の日銀ネット国債系の稼働時間 >

	日銀ネット国債系のオンライン入力締切時刻 (カッコ内は日銀ネット当預系の「5 時 同時処理」のオンライン入力締切時刻)
通常日（国債発行のない日）	午後 4 時 30 分（午後 5 時）
利付国債以外の国債（割引国債、 割引短期国債および政府短期証券）のみの発行日	午後 5 時 30 分（午後 6 時）
利付国債の発行日	午後 6 時（午後 6 時 30 分）

⁸ ただし、国債発行日（利付国債の発行日および利付国債以外の国債＜割引国債、割引短期国債および政府短期証券＞のみの発行日）における稼働時間は、オンラインにより資金の払込を行う国債の発行・払込が即時化されるまでの間の経過措置です。オンラインにより資金の払込を行う国債の発行・払込が即時化された後は、国債発行日における日銀ネット国債系の稼働時間は午後 4 時 30 分までとなります。

(予備日 < 12月16日 > を用いた R T に向けて)

次回 12 月 16 日の R T が、来年 1 月 4 日の R T G S 化実施に向けての最後の R T となります。日本銀行では、参加先において、次回 R T を利用して引き続き事務の習熟やシステムの運用確認が図られることを期待しています。

なお、次回 R T では、大手の利用先は引き続き殆どの先が参加される予定ですが、一部参加先の行（庫社）内の事情により、ラウンド 3 に比べ全体の参加者数は減少する見込みです（300 弱の先が参加の予定 < ラウンド 3 までは約 400 の先が参加 > ）。このため、たとえば不参加先に起因する国債決済の不処理などは、これまでに比べ増加する可能性が高いものとみられます。この点をご理解いただくとともに、各参加先においては、R T の趣旨を踏まえ、日中コールや当日レポなどの新しい取引に一段と積極的に取り組まれたり、必要に応じ従来の取引形態に新しいデータを付け加えるなどして、本番に向けた事務習熟の場としてさらに一層活用さ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 R T G S 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

(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

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3ラウンド（12/2日、12/3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%
ラウンド3	(12/2日) 99%台	(12/3日) 98～99%

(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 89%、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 ・相手方の処理遅延 ・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"> ・相手方の処理遅延
国債決済の迅速化（12時迄に概ね終了）	<ul style="list-style-type: none"> ・自社のシステムトラブル ・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 ・自社のシステムトラブル

1日の決済事務フローを円滑に行ったか^(注)（アンケート回答先に占める構成比）

（第1日目<12/2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（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%

前々回第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<12/3日>）

「行った」と回答した先：93% 「行えなかった」と回答した先：7%

参考：前回第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%

前々回第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 29%

（注）当該アンケートに「行えなかった」と回答した先には、「日中に決済は完了したが、決済には当初想定以上に時間がかかった」などの先を含みます。

3. 当座勘定（振替）時間帯毎決済件数・金額

(1) 12/2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	661	612	387	324	314	247	555	670	516	351	279	466	345	209	42	5,978
金額	479,764	353,020	246,478	206,406	68,652	48,622	100,398	109,432	79,008	21,582	53,880	128,434	135,824	165,639	50,708	2,247,850

(2) 12/3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	16:00-17:00	17:00-18:00	合計
件数	1,611	482	352	537	316	312	653	768	527	306	291	594	382	247	260	42	7,680
金額	177,111	37,186	32,992	41,707	35,222	17,376	77,631	95,033	38,510	31,954	44,057	72,367	65,751	120,698	39,115	63,060	989,768

4. 国債DVP時間帯毎決済件数・金額

(1) 12/2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
合計件数	1,215	1,766	1,040	920	360	337	173	112	54	42	51	20	46	12	1	6,149
合計金額	36,217	49,485	32,263	24,669	13,372	9,022	5,384	3,473	2,027	1,036	3,629	558	1,548	842	206	183,731

(2) 12/3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	17:00-17:30	17:30-18:00	合計
合計件数	1,839	3,789	2,087	1,845	1,184	862	497	423	254	161	108	95	1,305	1,108	421	202	41	1	16,222
合計金額	47,740	104,157	56,345	56,557	33,231	27,142	15,442	11,727	7,562	4,651	3,214	2,888	30,148	24,736	7,577	5,283	1,362	10	439,772

5 . 国債決済所要時間統計

(1) 12/2日 (土) 実施 < システム環境日付7/19日 > 分

平均 : 15.1分

< 参考 : 10/21日 (土) 実施分・平均38.1分 >
< 11/11日 (土) 実施分・平均17.9分 >

所要時間	件数		所要時間	件数	
		累計			累計
0～1分以内	26	26	10～15分以内	560	4,428
1～2分以内	440	466	15～20分以内	407	4,835
2～3分以内	1,048	1,514	20～25分以内	243	5,078
3～4分以内	783	2,297	25～30分以内	304	5,382
4～5分以内	448	2,745	30～35分以内	88	5,470
5～6分以内	295	3,040	35～40分以内	94	5,564
6～7分以内	243	3,283	40～45分以内	76	5,640
7～8分以内	208	3,491	45～50分以内	84	5,724
8～9分以内	205	3,696	50～55分以内	69	5,793
9～10分以内	172	3,868	55～1時間以内	52	5,845
			1時間超	312	6,157

(2) 12/3日 (日) 実施 < システム環境日付7/21日 > 分

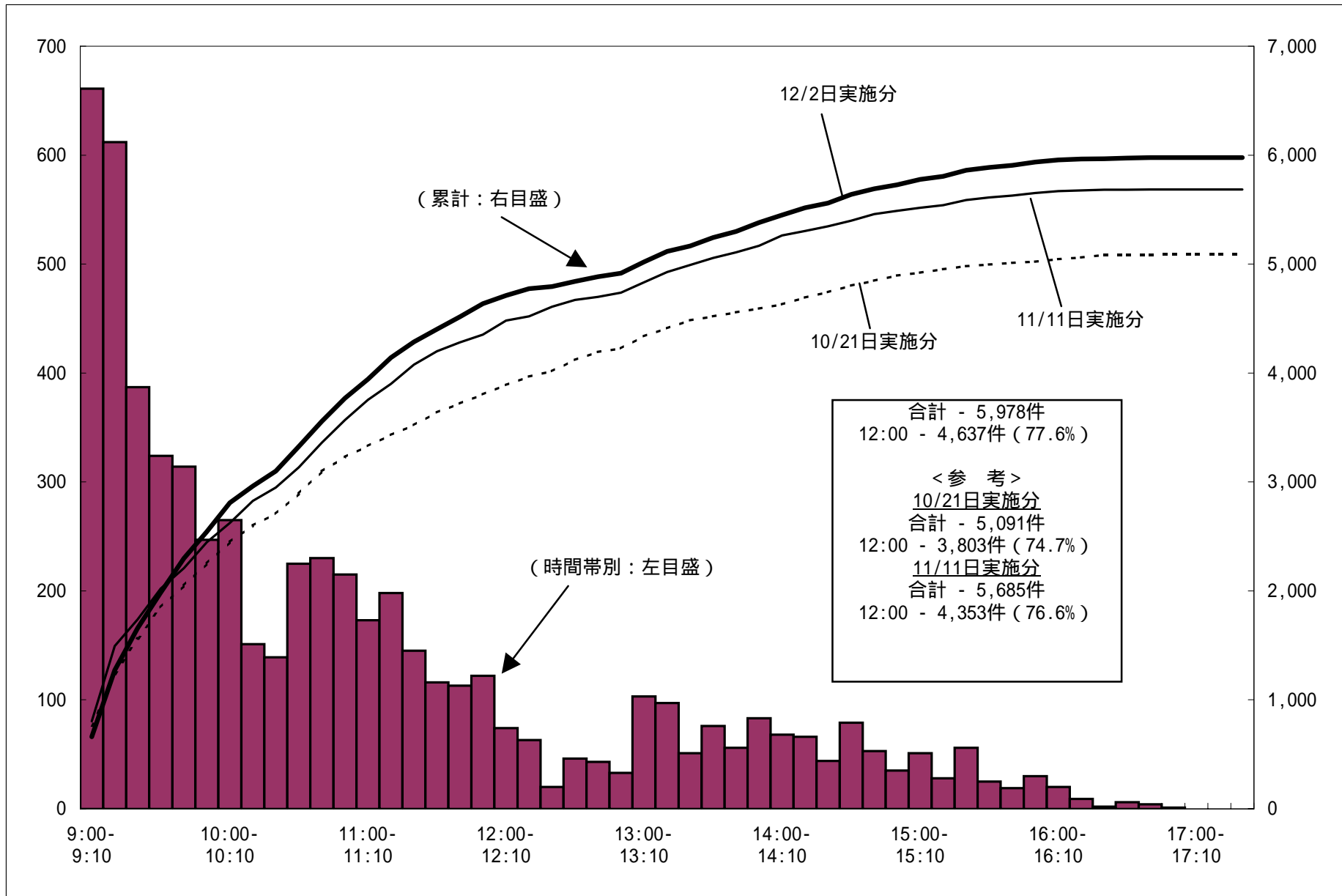
平均 : 14.2分

< 参考 : 10/29日 (日) 実施分・平均37.1分 >
< 11/18日 (土) 実施分・平均20.2分 >

所要時間	件数		所要時間	件数	
		累計			累計
0～1分以内	51	51	10～15分以内	1,475	11,584
1～2分以内	1,090	1,141	15～20分以内	1,123	12,707
2～3分以内	2,370	3,511	20～25分以内	861	13,568
3～4分以内	1,749	5,260	25～30分以内	707	14,275
4～5分以内	1,347	6,607	30～35分以内	440	14,715
5～6分以内	1,040	7,647	35～40分以内	272	14,987
6～7分以内	852	8,499	40～45分以内	199	15,186
7～8分以内	624	9,123	45～50分以内	184	15,370
8～9分以内	516	9,639	50～55分以内	186	15,556
9～10分以内	470	10,109	55～1時間以内	127	15,683
			1時間超	549	16,232

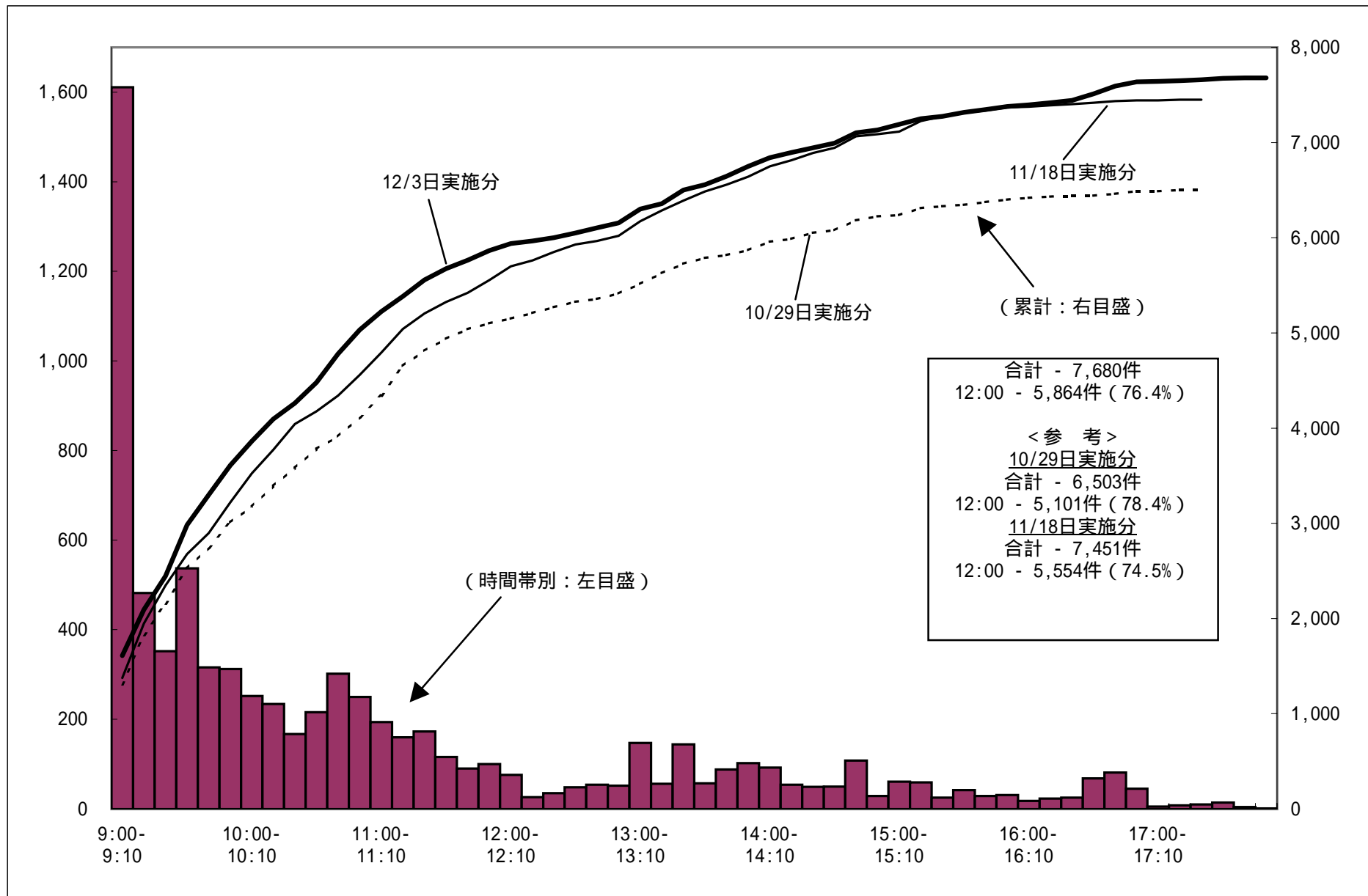
当座勘定（振替）時間帯毎決済件数

12月2日（土）実施分



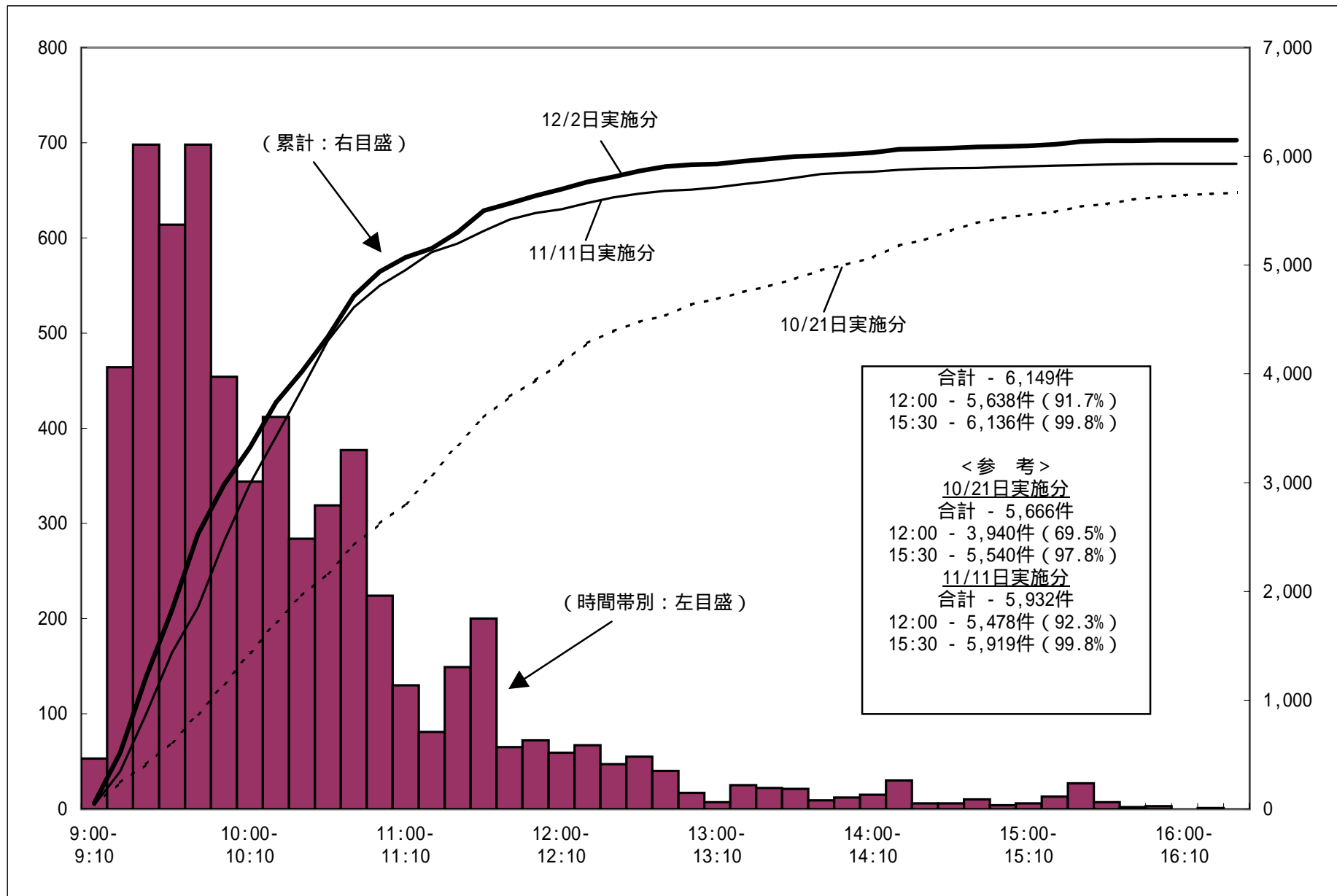
当座勘定（振替）時間帯毎決済件数

12月3日（日）実施分



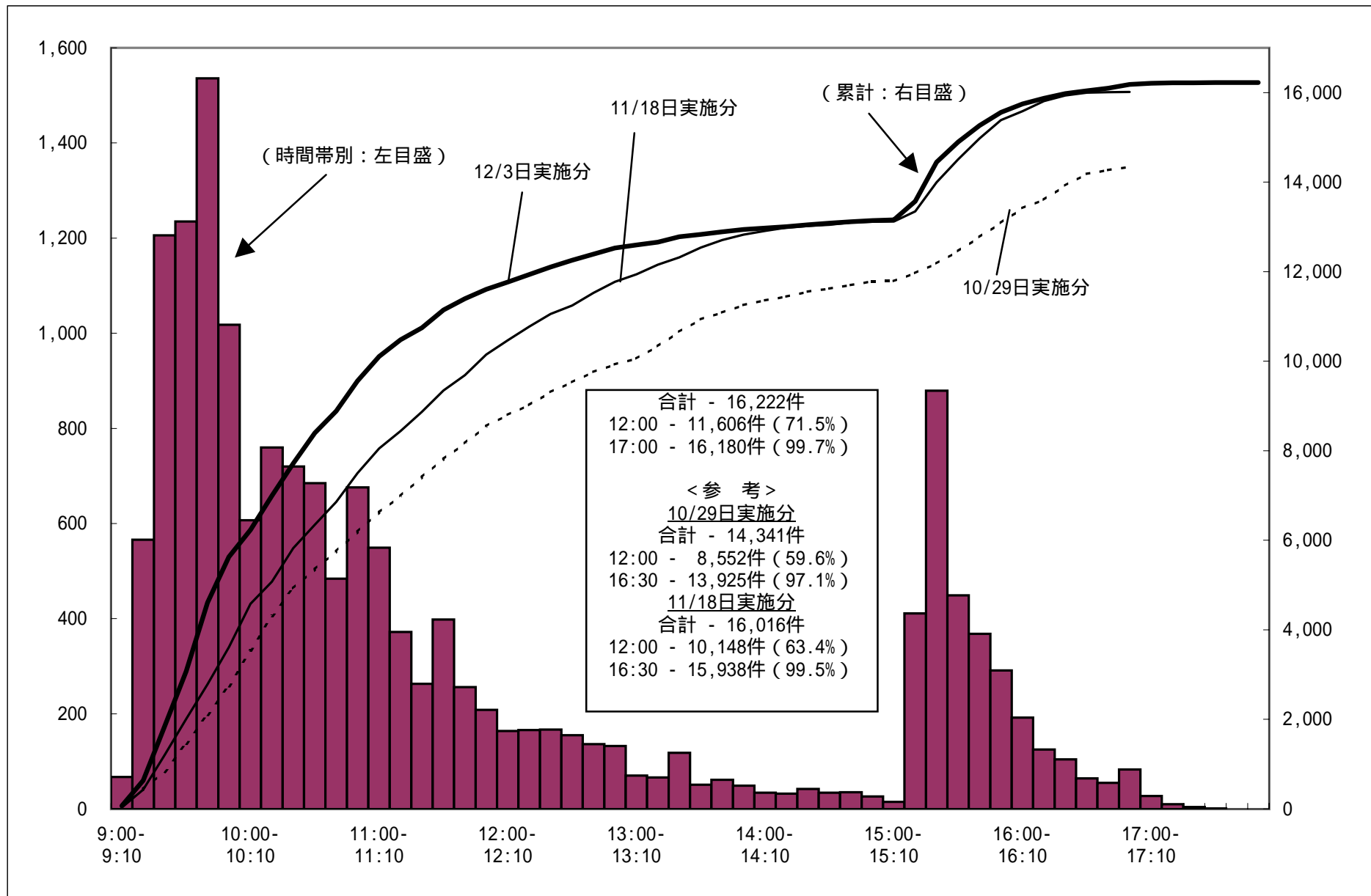
振込国債DVP時間帯毎決済件数

12月2日(土)実施分



振込国債DVP時間帯毎決済件数

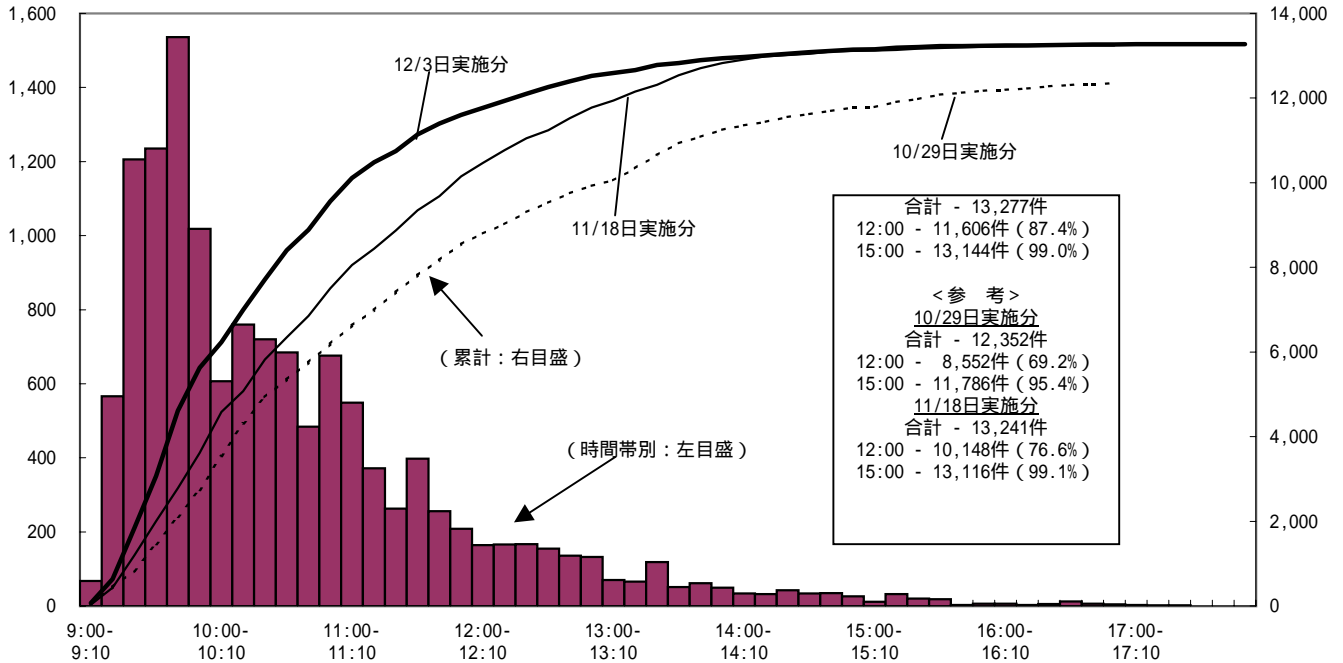
12月3日(日)実施分



既発債・新発債のDVP時間帯別決済件数

(ラウンド3・第2日目<12/3日実施>)

既発債



新発債

