

次世代 RTGS プロジェクト通信 第5号

— 目次 —

1. プロジェクトの進捗状況 (p. 1)
2. 各種試験の実施 (p. 2)
3. 稼動開始日に向けた準備作業 (p. 3)
4. 第2期対応の検討状況 (p. 4)
5. 連絡先 (p. 4)

〈参考〉次世代 RTGS 関連資料

1. プロジェクトの進捗状況

(1) 日本銀行におけるシステム開発

日本銀行では、第1期対応（流動性節約機能の導入と外為円取引の完全 RTGS 化）に関し、システム開発を予定通り進めており、現在は、品質・性能面等の最終確認に取り組んでいます。

こうした作業は順調に進捗しており、稼動開始日を最短で2008年10月14日とする方針に、今のところ変更はありません（稼動開始に向けたスケジュールの全体像は別添1をご参照ください）。

(2) 利用先の準備状況

日本銀行では、昨年11月から12月にかけて、各取引先に対し、総合運転試験の参加希望調査とあわせて、「当座勘定（同時決済口）」の開設予定の有無を伺いました。取引先におかれては、ご協力頂きありがとうございました。

昨年3月に行った「次世代 RTGS（第1期対応）に関するアンケート」では、「実務的な影響度合が見極めがたいため、開設の是非についてなお検討中」といった声が多く聞かれたところですが、今回の調査では、こうした先の多くから「開設する予定」との回答をお寄せ頂いております。

▽ 当座勘定（同時決済口）の開設予定状況

業態	先数	調査結果	
		開設する予定	開設しない予定
都銀	6	6	0
信託	21	17	4
地銀	64	64	0
地銀Ⅱ	45	45	0
外銀	60	47	13
信金	88	50	38
証券	42	35	7
短資	3	3	0
証券金融	3	3	0
その他	25	19	6
合計	357	289	68

* 日銀ネットを利用して当座勘定取引を行っている先（各銀行協会を除く）の回答結果。

調査結果によると、日銀ネットを利用して当座勘定取引を行っている357先のうち、約80%にあたる289先が、次世代 RTGS の導入にあわせて「当座勘定（同時決済口）」を開設する予定としています。これを取引量で見ると、日銀当座預金振替全体の取引量（日銀ネットを利用していない取引先分を含む）に占める開設予定とした先の割合は、件数ベース、金額ベースともに98%となっています。

「当座勘定（同時決済口）」の開設予定先におかれては、自社システムのメンテナンスや事務フローの確認など、引き続き、稼動開始に向けた諸準備を進めて頂ければと思います。また、同口座を開設しない先についても、特に市場参加者におかれては、取引相手方や決済代行の委託先との間で、新制度移行後に利用する決済口座の確認等の作業が必要となりますので、宜しくお願いいたします。

2. 各種試験の実施

利用先が参加する各種試験については、テスト内容の検討等をほぼ終了し、実施に向けての最終的な準備作業の段階に進んでいます。利用先におかれても、各試験の目的・内容等をご理解のうえ、参加準備を整えて頂きますようお願いいたします。

(1) オンライン・性能負荷試験

昨年7月に実施したオンライン・性能負荷試験への参加希望調査によれば、CPU接続およびファイルアップロード・ダウンロード機能の利用先のうち、「当座勘定（同時決済口）」の開設を予定している全ての先が、これらの試験への参加を予定しています。

これに関し、同11月には、参加予定先に対して「オンライン試験等の実施手順書」を送付し、当日の試験項目・手順の詳細等をお示したところです。

▽ オンライン・性能負荷試験等の日程

日付は2008年

テストフェーズ	実施予定日
オンライン試験1回目	3/9（日）
オンライン試験2回目	4/6（日）
性能負荷試験	4/27（日）
リグレッションテスト	5/25（日）

なお、後述する総合運転試験中（5月25日）に、CPU接続対象電文の送受信確認を行うリグ

レッションテスト（各先が既に利用しているCPU接続対象電文の送受信確認）を行います。同テストについても、各証券・資金決済システムの運営者を含め、「当座勘定（同時決済口）」の開設予定先以外を含む全てのCPU接続先にご参加頂くことになりました。

(2) 総合運転試験（RT）

RTは、主に日本銀行が作成する実施手順書に沿って、「当座勘定（同時決済口）」に関する日銀ネットの運用確認・習熟を図るためのフェーズⅠと、市場関係者に企画していただく内容に沿って、本番環境に極力近い環境で、新しい市場慣行に基づく取引・決済の運営方法を実践的に確認していただくフェーズⅡの、2段階に分けて実施します。

これまで、日本銀行では、昨年7月に試験内容の概要書を開示し、同11月から12月にかけて、RTの参加希望調査を実施しました。

それによれば、各フェーズともに「当座勘定（同時決済口）」の開設予定先の多くが参加を予定しており、日本銀行としても、十分に実効的な試験を行い得る環境が整ったものと考えています。なお、同調査の結果を受け、日銀ネットのシステム運用日付も確定しました。

① フェーズⅠ

フェーズⅠに関しては、本年2月末を目処に、「実施手順書」をRTの参加先にお送りいたします。その際、フェーズⅡも含めた試験参加先・連絡責任者の一覧をあわせて送付する予定です。各参加先におかれては、手順書の内容をご確認のうえ、準備作業をよろしくごお願いいたします。

② フェーズⅡ

フェーズⅡでは、試験日ごとに、通常日（5月12日）、外為円決済の繁忙日（5月7日）、短期金融市場取引の繁忙日（6月30日）と、それぞれ異なる想定日を設定したうえで、各シナリオの下での取引・決済の運営方法を実践的に確認して頂くこととなります。

▽ RT の参加先数と実施日等

日付は 2008 年

テストフェーズ		参加予定先数	実施日	システム運用日付	想定日
フェーズⅠ	第 1 回	288	5/25 (日)	5/12 (月)	
フェーズⅡ	第 1 回	282	6/15 (日)	5/12 (月)	5/12(月)
	第 2 回	224	8/ 3 (日)	5/13 (火)	5/ 7(水)
	第 3 回	280	9/ 7 (日)	8/25 (月)	6/30(月)
	予備	245*	9/21 (日)	8/25 (月)	未定

* 予備日に試験が実施された場合に参加可能な先数。

日本銀行では、次世代 RTGS プロジェクト通信第 4 号でお伝えしたとおり、短期金融市場取引活性化研究会(短取研)および東京銀行協会(東銀協)に対し、フェーズⅡの留意点や試験の確認ポイントの取纏めをお願いしていたところ

です。
これを受けて、短取研や東銀協では、試験実施に当たっての具体的な留意事項(想定日における実際の取引データの利用方法、業務開始時に確保すべき流動性の水準等)を整理するとともに、日本銀行と調整しつつ試験結果データの還元方法や確認ポイントの検討を進めています。

今回、現時点における取纏め結果を別添 2、3 として添付しておりますので、フェーズⅡの参加予定先におかれては、当該資料をご覧のうえ、必要な準備を進めていただくようお願いいたします。

なお、フェーズⅡでは「当座勘定(同時決済口)」の開設予定先に加えて、開設予定先に決済業務を委託している金融機関等にも、必要に応じて取引データのご提供等にご協力頂く予定です。こうした点についても短取研において検討が進められていますので別添 2 をご参照ください。

今後は、短取研や東銀協の検討内容を取り纏める形でフェーズⅡの実施手順書を作成し、本年 4 月頃に、RT の参加先に対して開示する予定です。

短取研や東銀協におかれては、引き続き留意事項の整理を進めて頂くとともに、上記実施手順書の作成、および試験当日の連絡体制の検討等につき、ご協力いただければと思います。

(3) 障害対応試験

第 4 号でもお伝えしたとおり、日本銀行では、例年実施している CPU 接続先を対象としたコンピュータ接続サイト切替訓練を、第 1 期対応後の環境を反映した形で行うことを検討していましたが、今般、本年 6 月 29 日(日)に同訓練を実施する運びとなりました。今後は、実施 2 ヶ月前までを目処に、CPU 接続先に対して試験内容をお示しするとともに参加希望調査を実施する予定です。

3. 稼働開始日に向けた準備作業

日本銀行では、上述の各種試験の実施に加え、稼働開始日に向けた実務的な準備作業も進めています。

具体的には、本年半ば頃に、取引先に対して、「当座勘定(同時決済口)」の開設手続きにつき、正式にご案内する予定です。

また、10 月 14 日を稼働開始日とした場合の、直前 3 連休(10 月 11~13 日)における移行体制についても具体的な検討に入っています。現時点では、以下にお示しするスケジュールをイメージしていますが、今後、稼働開始日前後の詳

細な計画や留意事項についても、関係先の皆様にお知らせする予定です。

(注) 第3号では、最初の2日間で日本銀行におけるシステムの変更作業とその後の稼動確認を行ったうえで、3日目に利用先との間のオンライン接続確認試験(連休明けの本番環境を想定したCPU接続の最終確認等)を行うとしていました。この間、寄せられたご意見も踏まえ改めて検討した結果、オンライン接続確認試験で万が一問題があった場合のシステムの戻し作業等にかかる時間を確保する等の観点から、スケジュールを一部変更し、オンライン接続確認試験を3日目ではなく、2日目とする方向で検討を進めています。

▽ 稼動開始日前後の作業日程イメージ

日付は2008年

作業予定日	作業内容
10/11(土)	システム移行作業
10/12(日)	オンライン接続確認試験
	稼動開始可否の判断
10/13(月・祝日)	作業予備日
10/14(火)	稼動開始
(11/25(火))	(稼動開始予備日)

利用先には、稼動開始に向け十分な移行体制を整えていただくこととなりますが、それと同時に、万一の場合に対する備えも重要と考えています。

このため、所要の準備作業と並行して、主に以下の二つのケースに対する対応策の検討も進めて頂くようお願いいたします。

- ① 次世代RTGSは予定どおり10月14日に稼動開始したが、自社システムの移行作業の不調等により自らの対応が十分に整わなかった場合
- ② 10月14日の次世代RTGSの稼動開始が延期された場合

また、短取研や東銀協におかれても、上記①、②の双方のケースに関して、市場取引、外為円取引上の留意点や具体的な対応方法につき、予め整理しておいて頂きますようお願いいたします。

4. 第2期対応の検討状況

次世代RTGS第2期対応(大口内為取引のRTGS化)については、昨年4月に内国為替運営機構内に設置された「次期全銀システム検討部会」を中心に、関係者による具体的な検討が進められています。

この間、同機構では、第6次全銀システムの稼動開始の目処を2011年11月としたうえで、従来日本銀行からお示ししていた将来イメージとも沿う形で、日銀ネットとのインターフェース仕様の大枠(別添4参照)を整理したところです。また、RTGS化の対象となる大口内為取引の金額水準は1億円以上としています。

今後は、上記インターフェースの要件を具体的に固めていくこととなりますが、日本銀行としても、上記部会の提案内容やスケジュール観を踏まえつつ検討を進めていく予定です。また、その際には、スキーム確定に向けた検討状況や日本銀行の考え方につき、適切なタイミングで皆様に情報を提供していきたいと考えています。

5. 連絡先

次世代RTGS全般に関するご質問・ご意見等は下記連絡先宛にお寄せ下さい。電子メールでご連絡頂く際は、件名の冒頭を「次世代RTGS」として下さい。

(連絡先)

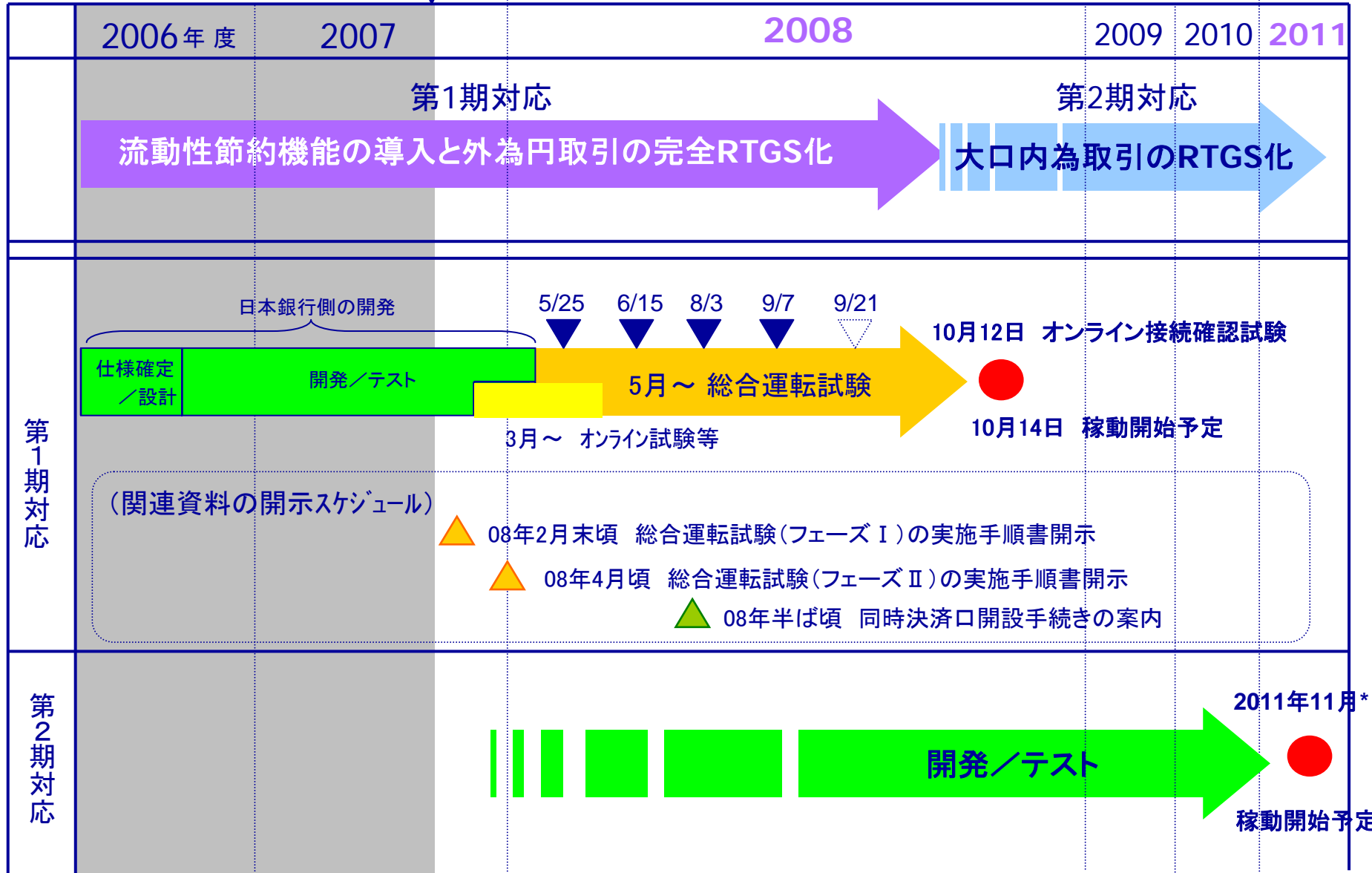
日本銀行 決済機構局 決済企画担当
電子メール post.payment@boj.or.jp
代表電話 03-3279-1111 内線 2963

〈参考〉次世代 RTGS 関連資料

- 日本銀行決済機構局「次世代 RTGS プロジェクト通信」（創刊号～第 4 号）
- 日本銀行「決済システムレポート 2006（第 2 部第 1 章）」（2007 年 7 月）
- 日本銀行決済機構局「日本銀行当座預金決済の新展開 — 次世代 RTGS 構想の実現に向けて —」日本銀行調査季報（2006 年 9 月）
- 日本銀行「日本銀行当座預金決済における次世代 RTGS の展開 — 関係者のご意見を踏まえて —」（2006 年 2 月）
- 日本銀行「日本銀行当座預金決済における次世代 RTGS の展開」（2005 年 11 月）
- 全国銀行協会「大口決済システムの構築等資金決済システムの再編について」（2005 年 3 月）

次世代RTGSのスケジュール観

▼ 現在



* 内為運営機構の提案による第6次全銀システム稼動開始の目処。

【平成 20 年 1 月 短取研資料】

平成 20 年 1 月 21 日

短取研幹事

次世代 RTGS 総合運転試験フェーズⅡにかかる要検討事項について

「次世代 RTGS 総合運転試験フェーズⅡの試験内容（平成 19 年 11 月暫定版）」における未確定事項については、11 月以降の短取研における検討内容を踏まえ以下の項目について確定した上で、「総合運転試験フェーズⅡ 実施手順書」を作成することとしたい。

1. 想定日の実取引データからの読み替え方法について

フェーズⅡ1 回目及び 2 回目は、想定日の日銀ネット稼働時間より 1 時間短い（フェーズⅡ3 回目は、想定日の日銀ネット稼働時間より 2 時間短い）ことから、以下の通り想定日における決済時刻について読み替えを行う。

また、15：30 の多者間同時決済の起動は行われない。

（日銀ネットにおけるシステム運用時刻は、終日、テスト当日の実際の時刻と同一）

(1) フェーズⅡ1 回目及び 2 回目

- ア. スキップ時間帯として、14：30～15：30 を設定する。
- イ. 9：00～14：30 の件別については、想定日と同一とする。
- ウ. 14：30～15：30 の件別については一律 14：30 と読み替える。（注 1）
- エ. 15：30～16：30 の件別については、1 時間繰り上げる。
- オ. 16：30 以降の件別については、同時決済口における決済が 16：30（テスト日における 15：30）までとなっていることから、通常口での決済となる。

(2) フェーズⅡ3 回目

- ア. スキップ時間帯として、14：30～16：30 を設定する。
- イ. 9：00～14：30 の件別については、想定日と同一とする。
- ウ. 14：30～16：30 の件別については一律 14：30 と読み替える。（注 2）
- エ. 16：30～17：30 の件別については、2 時間繰り上げる。
- オ. 17：30 以降の件別については、延長日における同時決済口における決済が 17：30（テスト日における 15：30）までとなっていることから、通常口での決済となる。

（注 1）（注 2）14:30 には多者間同時決済処理が起動するため、スキップ時間帯の取引の決済時刻を 14:30 と読み替えた場合、指図の送信は 14:30 以前に行う必要がある。

2. 通常口の決済について

フェーズⅡテストにおける通常口での決済は任意とし、かつ決済を行う場合は以下の通りとする。

(1) 想定日における実取引データのうち、次世代 RTGS 後において「同時決済口入力締切時限以前を決済時刻として通常口で決済」する件別について、テストにおいて通常口にて決済を行う場合は、相手方（被仕向先）の同意が必要（実際には、次世代 RTGS 後も引き続き通常口で決済を行うことになる DVP 決済を除けば極めて例外的と思われる）

(2) 想定日における実取引データのうち、次世代 RTGS 後において「同時決済口入力締切時限以降を決済時刻として通常口で決済」する件別について、テストにおいて通常口で決済を行う場合は、相手方（被仕向先）への事前連絡や同意は不要。

（例えば、想定日（1 回目）において、16：40 を決済時限とするコール取引の決済（想定日における実際の決済指図投入時刻及び相手方への着金時刻について 16：30 の前後を問わない）を、フェーズⅡテストにて通常口で決済を行うことについては相手方（被仕向先）への事前連絡や同意を不要とするもの。（相手方への着金が同時決済口入力締切時限以前となる場合を含む）

3. 「決済時刻」の考え方について

テストにおける「決済時刻」の考え方は以下の通り。

(1) コール取引等、決済時限が約定において明確に決められている件別、及び NCD 等の市場慣行で決済時間（帯）が決められている件別

⇒約定における決済時限、または市場慣行における決済時限。

尚、各参加者が、「決済時限より『一定時間早く』決済指図を投入」している場合で、次世代 RTGS 後に「一定時間」を変更する（より速やかな決済完了を目指す）場合に、テストにおいて当該変更を行うことは問題ない。（相手方への事前連絡や同意は不要）

(2) 決済時限の取り決め又は市場慣行の無い件別

⇒想定日に指図投入を行った時刻を基本とする。

（可能な限り想定日と同一時刻に指図投入することが望ましいが、テストにおける事前準備及びテスト当日の負担等を考慮したもの）

4. 想定日における実取引データからの変更について

以下の場合においては、想定日の実取引データからの変更を希望する市場参加者が、希望する相手方に対して連絡し、調整を行う。「想定日の実取引における決済内容からの変更」は、相手方における「次世代 RTGS 後に必要な日中流動性量」の検証に影響を与えることに十分留意するものとし、相手方の同意が得られない場合は、想定日の実取引内容から変更を行わないものとする。

- (1) 想定日における実取引データから決済時刻等を変更したい場合（注3）
- (2) データを間引く等、想定日における実取引データから決済金額を変更したい場合
- (3) 想定日の資金決済データには存在しなかった「仮想データ」を作成して決済を行いたい場合（テスト日当日における「約定」は行わずに、決済のみを行う場合）
- (4) テスト当日に、短資媒介またはダイレクト取引にて約定を行った上で資金決済を行う（＝仮想取引）ことにつき、予め打診等を行っておきたい場合

（注3）上記1.の通り、テストにおける日銀ネット稼働時間の制約により、特定の時間帯を決済予定時刻としていた件別については読み替えを行う。当該件別については、相手方への事前連絡や同意は不要。

上記(1)～(3)の変更を希望する参加者は、想定日における取引相手に対し、フェーズⅡ1回目に関しては5月末日まで、2回目・3回目に関してはテスト日の1ヶ月前までに、変更希望の旨連絡し、調整を行うものとする。

また、上記(4)仮想取引についても、原則として上記期限までに調整を行うものとする。

（最終的にはテスト日当日に当事者間で合意(約定)すれば仮想取引は可能であるものの、「予め打診等を行っておきたい場合の調整期限目処」を明確化しておくもの。）

想定日に実取引データが1件も無い（又は少ない）と見込まれる参加者が仮想データの作成を希望する場合は、短資媒介取引については短資会社に、ダイレクト・ディール・コールについては自社における過去の取引相手等へ相談し、原則として上記期限までに調整を行うものとする。

尚、フェーズⅡ3回目において、想定日における短資媒介取引の内容を変更する場合(上記(1)～(3)の場合)は、テスト日の1ヶ月前までに、媒介を行った短資会社に取引当事者の双方が連絡する。テスト日においては、当該変更を反映した内容で短資約定確認システムに反映される。（取引当事者双方が短資約定確認システム利用先の場合）

フェーズⅡ3回目においてテスト当日に短資媒介にて約定を行った場合は、短資約定確認システムへ約定内容が反映される。（取引当事者双方が短資約定確認システム利用先の場合）

（フェーズⅡ1回目・2回目は、短資約定確認システムは稼働しない予定）

5. 同時決済口へ投入する金額の上限について

(1) 業務開始時点（9：00 過ぎ）の同時決済口振替金額上限について（9：00～9：20 の上限）

①原則として、各参加者における、「想定日の決済データに基づいて算出した日中流動性額（日中の仕向け超ピーク額）（注 4）」の 50%以下で、各参加者が望ましいと考える金額を投入する。

9：20 までは、同時決済口に資金の追加投入を行う場合でも、業務開始以降に同時決済口へ投入した金額の累計を上記上限以内に抑える。

②ただし、上記①とすることにより、例えば 9：15 を決済時限とする仕向送金が行えない等の事態となる場合は、各参加者の判断にて上記①を上回る資金の追加投入を行う。

③ フェーズⅡ 2 回目・3 回目については、上記①②を基本に、フェーズⅡ 1 回目（・2 回目）の結果を踏まえて検討を行う。

(2) 日中における同時決済口振替金額上限について（終日の上限）

各参加者における、実際の資金繰り・担保繰りを勘案し、現実に振替可能と想定される金額を上限とする。

（注 4）日中の仕向け超ピーク額の具体的な算出例

次世代 RTGS 後は外為円決済制度における資金決済が大幅に変更となることから、日中仕向け超ピーク額の算出方法については、別途東銀協と擦り合わせを行う。

6. JGBCC にかかる決済について

フェーズⅡにおける JGBCC の参加は、3 回目のみとする。（予備日にテストが行われることになった場合は左記に加え予備日も参加）

各参加者における、JGBCC に関連する決済は任意とし、かつ希望する参加者における調整方法等については引き続き短取研幹事及び証券会社間で検討を続ける。

7. 次世代 RTGS にて、他社へ日銀ネット決済委託を開始する参加者にかかる、テストにおける決済の取扱について

現在、自己の日銀当座預金を通じて決済を行っている市場参加者のうち、次世代 RTGS 開始後は決済受託金融機関を通じて決済を行う市場参加者については以下の取り扱いとする。

(1) 次世代 RTGS 開始後に決済受託金融機関を通じた決済へ変更する市場参加者は、想定日における取引相手方に対し、決済委託開始の旨、及び決済受託金融機関名を通知する。

(2) 通知された取引相手方は、当該決済受託銀行との間で、原則、決済受託金融機関を通じて決済を行う前提でテストにおける決済内容について確認を行う。

(3) 上記(1)(2)についての完了期限は、フェーズⅡ 1 回目に関しては 5 月末日まで、2 回目・3 回目に関してはテスト日の 1 ヶ月前までとする。

9. フェーズⅡ3回目における、投信委託会社（及び生損保等）の参加について

当座勘定（同時決済口）を開設しない短期金融市場参加者のうち、短資約定確認システム利用先は、3回目（2008年9月7日（日））のテスト当日に、想定日の決済データに基づき反映される次世代RTGS対応の短資約定確認システムにてサイン入力を行うこと等により、接続・稼働確認を行うことが推奨される。（1回目及び2回目のテストにおいては、次世代RTGS対応の短資約定確認システムは稼働しない予定）

当座勘定（同時決済口）を開設しない短期金融市場参加者のうち、決済受託金融機関又は受託信託銀行と電子的に決済データ授受を行っている先は、3回目（2008年9月7日（日））のテスト等を利用し、決済受託金融機関又は受託信託銀行との決済データ授受の確認を行うことが推奨される。

以 上

平成20年1月31日

次世代RTGS（第1期対応）の総合運転試験（フェーズ2）について

東京銀行協会 外国為替円決済制度運営部会

1. 総合運転試験の日程等

日付は2008年

	テスト予定日	システム運用日付	データ取得日（想定日）
①	6月15日（日）	5月12日（月）	5/12（通常日）
②	8月3日（日）	5月13日（火）	5/7（外為円ピーク日）
③	9月7日（日）	8月25日（月）	6/30（当預のピーク日）

（注）上記日程に加え、6月29日（日）に、CPU接続行を対象としたサイト切替訓練を、第1期対応後の環境を反映した形で行うことを予定。

2. 参加先の範囲

- ・総合運転試験の全ての日程について、加盟銀行の参加は必須とする。

3. 試験項目等

項 目	内 容
1.紳士協定の遵守状況の確認	・紳士協定（仮置き：午前11時までに1日の外国為替円決済（同時決済口）の支払指図の取扱量のうち件数の65%、金額の55%（待機された支払指図を含む。）を送信する。）の達成状況を確認する。
2.モニタリング	・上記紳士協定を達成するために、外為円部署における「支払指図通数・金額」（取引種別）および資金部署における「受払残高」に基づいてモニタリングする。
3.待機指図の並べ替え	・決済の円滑化のため、待機指図の並べ替えを行う（外為円部署と資金部署の連絡・待機指図の待ち行列の先頭/最後尾への移動）
4.流動性の追加等	・決済の円滑化のため、追加流動性を当座勘定から当座勘定（同時決済口）に振替。余資の払い出し。
5.カットオフ時における待機指図の自動取消後の対応	・午後2時のカットオフ時に待機していた指図が自動取消となった場合、当該取り消された指図をグロス決済により決済する処理。

4. データの作成方法等

- ・データ取得日（通常日・繁忙日・月末日）のデータ（自行分・SWIFT 受信分・委託銀行分等）を保存し、それを基にテスト・データを作成する。なお、これが不可能な場合には、当該日の仕向け相手ごとの件数・金額となるようデータ（ただし、当該指図が被仕向銀行の委託銀行宛またはコルレス銀行宛の場合には当該委託銀行名または当該コルレス銀行名を含める。なお、それ以降に連鎖する場合の情報は不要。）を作成するものとする。
- ・テストにあたっては、金額の決済進捗を促進するために、大口の支払指図を現実的な範囲内で前倒し投入するよう調整する必要がある。
- ・現行のグロス決済支払指図（CLS関連を除く、限度額管理に抵触してネット決済で支払えなかった取引等）についても、現実的な範囲内で同時決済口を決済勘定とするようテスト・データを作成する。
- ・テスト結果を検証するため、フィードバック可能なデータ（別添参照）については、すべての項目の還元を日本銀行に要請する。

また、追加情報として、紳士協定の達成のための参考資料として、現行のネット決済の日中の進捗率（金額・件数ベース）を、データ取得日について還元するよう要請する。

さらに、日銀当座勘定（同時決済口）の初期残高*の決定のための参考資料として、2007年5月7日（月）、6月29日（金）のデータを基に、第1期対応下のマクロ的な決済状況のシミュレーションを行い、結果を還元するよう要請する。

（注）短取研では、初期残高について、データ取得日の日中流動性（日中の仕向け超ピーク額に相当）の一定割合とし、流動性節約効果を確認することを想定している。

5. フェーズⅡの1日（9:00～16:00）のテストの流れ

実施時間帯	テ ス ト の 概 要	
	外国為替円決済制度加盟銀行以外	外国為替円決済制度加盟銀行
9:00～11:00	（短取研で検討）	○紳士協定遵守状況の確認 ○各種モニタリング ○待機指図の並べ替え ^{（注1）} ○流動性の追加等 ^{（注1）}
11:00～15:00	（短取研で検討）	○カットオフ時における待機指図の自動取消後の対応 ^{（注1）} ○フリー・アクセス ^{（注2）}
15:00～16:00	（短取研で検討）	○フリー・アクセス ^{（注2）}

（注1）待機指図の並べ替えや流動性の追加等新たに導入された機能の確認はフェーズ1

で行われる予定であるため、フェーズ2では当該機能の発動が必要な状態となった場合に適宜実行することとし、当該状況の作り出しはあえて行わないこととする。

(注2) フリー・アクセスは、試験項目について相手行との合意に基づき希望者同士が各自調整のうえ実施する。

以 上

(本件照会先)

社団法人東京銀行協会

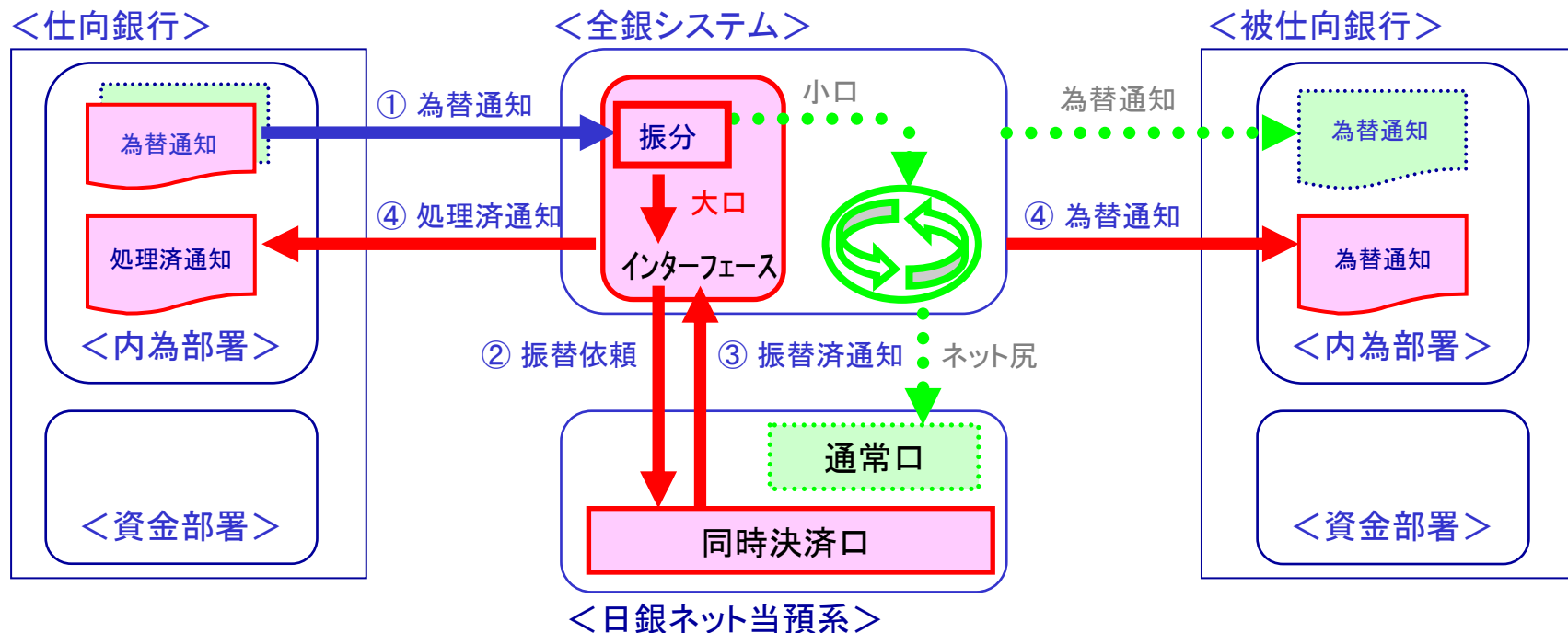
事務システム部 佐方 Tel: 03-5252-3750

○ フィードバック可能な集計データの例

集計データ
業務処理区分コード毎の決済件数・金額
日中(10分毎)の決済進捗率 (金額・件数ベース)
日中(10分毎)の同時決済口残高の推移およびピーク残高
日中(10分毎)の待機件数・金額の推移
支払指図の待機時間 (金額加重平均)
当座勘定備考コード毎の決済件数・金額
決済処理方式毎の金額・件数 (二者間同時決済処理、単独決済処理、多者間同時決済処理毎の金額・件数)
仕向超ピーク額
ネット受払尻 (負け額)

次世代RTGS(第2期対応)の概要

大口内為取引(1億円以上)について、全銀協が新たに構築するインターフェース経由で、同時決済口において日中即時に決済することを可能とする。



- ① 仕向銀行は、全銀システムに為替通知を送信する。
- ② 全銀システムは、原則1億円以上の大口内為取引に関し、為替通知をセンターに一時的に保留する一方、資金決済に必要な情報(顧客情報は含まない)を抽出し、日本銀行に同時決済口の振替依頼を送信する。
- ③ 日本銀行は同時決済口の引落・入金処理後、全銀システムに振替済通知を送信する。
- ④ 全銀システムは振替済通知を受信後、仕向銀行に処理済通知、被仕向銀行に為替通知を送信する。