

国債の決済期間の短縮化に関する検討ワーキング・グループ(第18回)

平成23年3月18日(金) 午後4時
日本証券業協会 第1会議室

議 題

1. 約定照合分科会及び相対ネッティング照合分科会における検討状況 について

- ・ 「国債の即時グロス決済に関するガイドライン改訂案」の検討
- ・ 「機関投資家や信託銀行と証券会社等の間のフロント照合及び出来通知データの授受等に関する実務取扱指針(案)」の検討
- ・ 「相対ネッティング照合等の実務に関する取扱指針(案)」の検討

他

2. アウトライトT+2化の実施日について

3. その他

以 上

国債の即時グロス決済に関するガイドライン改訂案

IV. 二当事者間におけるネットティングに関するガイドライン

1. 標準的なネットティング・スキーム

市場参加者は、以下の取扱いを行うに当たり、書面の有無は問われないものの、当事者間で事前に本取扱いを行う旨の合意が成立している必要があることに留意する^(注4)。

(注4) 本取扱いの取りまとめに当たっては、その日本法上の有効性を弁護士に確認している。

(1) ネットティングの形態

二当事者間で履行期を同じくする国債の引渡債務及びこれに伴う資金の支払債務がそれぞれ相対立する形で存在する場合に、これら債務を国債、資金ごとに差引計算し、それらの差引額について決済を行う形態とし、この差引額決済が完了しない限りは、当該ネットティングの対象となっている原約定の債権債務の関係がそのまま存続することとする（以下「バイラテラルのペイメント・ネットティング」という。）。

(2) 対象となる決済数量

同一銘柄・同一額面の国債に係る取引のネットティング（以下「ペアオフ」という。）を対象とする。

(3) 対象となる決済方法

DVP 決済の取引を対象とする。

(4) 対象となる取引の約定照合時限

受渡日を基準とし、受渡日前営業日の約定照合時限の目安（午後 3 時 30 分から午後 3 時 45 分）までに約定照合が完了した^(注5) 正午までに約定した取引を対象とする。

(注5) ㈱証券保管振替機構が提供する決済照合システムを使用した約定照合の場合、「約定照合が完了した」とは、同システムを通じて売買報告データが承認されたこと又は一致したことをいう。

(5) 対象となる取引種別

売買（条件付現先売買を含む。）取引同士及び現金担保付貸借取引同士、並びにこれらの取引相互間を対象とする^(注6)。

（注6）条件付売買取引はスタート取引及びエンド取引、現金担保付貸借取引は貸出及び返済を対象とする。

(6) 対象となる国債の保有形態

振替国債を対象とする。

(7) 対象となる口座

取引口座単位に行うものとし、異なる取引口座間におけるネットィングは行わない。

(8) ペア付けの方法

受渡金額をキーとして、受渡金額の大きい高いものから順にペア付けを行う。なお、同一受渡金額の取引が存在する場合の取扱いは、取引当事者間で確認することで対応する。

(9) 受渡金額が同額である場合のネットィング効力の発生時限

ネットィング対象取引双方の受渡金額が同額であり、ネットィングの結果、実際に資金の受払いが生じなかった場合には、決済日当日における日銀ネットの決済開始時刻である午前9時をもってネットィングの効力が発生することとする。

(10) 資金決済口座の指定

原則として、日本銀行当座預金口座を指定する。

2. 標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング

(1) 市場全体としての決済量の圧縮等による事務効率の向上、資金負担の削減の観点から、当事者間の合意がある場合には、上記1. に示す「標準的なネットィング・スキーム」の「バイラテラルのペイメント・ネットィング」を前提としたうえで、上記1. の(2)及び(8)の項目を変更した、同一銘柄・異額面の国債に係る取引のネットィング（以下「異額面のペイメント・ネットィング」という。）を「標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング」として行うことができる。

ただし、この場合においても、決済の円滑性確保等の観点から上記1. の(3)～(7)、(9)及び(10)の項目は、標準的なネットィング・スキームに基づいて行う

こととする。

(2) (1)に基づいて、異額面のペイメント・ネットィングを行う場合には、「1対1の異額面のペイメント・ネットィング」又は「集約方式の異額面のペイメント・ネットィング」のいずれの方法を選択するか当事者間で合意したうえで、上記1.の(8)の項目によらず、以下の取扱いを行う。

① 1対1の異額面のペイメント・ネットィング

1対1の異額面のペイメント・ネットィングを行う場合のペア付けは、標準的なネットィング・スキームにおけるペアオフの対象とならなかった取引に関し、次の手順により行う。

- (イ) ペアオフの対象とならなかった取引に関し、額面金額をキーとして、額面金額の大きいものから順にペア付けを行う。
- (ロ) 額面金額が同一の取引が複数ある場合には、受渡金額の大きいものから順にペア付けを行う。
- (ハ) 額面金額及び受渡金額が同一の取引が複数ある場合には、約定日付の古いものから順にペア付けを行う。
- (ニ) 額面金額、受渡金額及び約定日付が同一の取引が存在する場合の取扱いは、当事者間で確認することで対応する。

② 集約方式の異額面のペイメント・ネットィング

集約方式の異額面のペイメント・ネットィングとは、標準的なネットィング・スキームにおけるペアオフの対象とならなかった取引に関し、同一銘柄における決済総額を算出し、その差引額を決済する方式の異額面のペイメント・ネットィングをいう。

集約方式の異額面のペイメント・ネットィングは、次の手順により行う。

- (イ) ペアオフの対象とならなかった取引に関し、銘柄ごとに、国債の渡し方となっている全ての取引の引渡総額と、国債の受け方となっている全ての取引の受取総額を算出する^(注7)。
- (ロ) (イ)の引渡総額と受取総額のいずれか大きい方を構成する全ての取引を次の手順に従って順位付けする。
 - (a) 額面金額をキーとして、額面金額の大きいものから順位付けする。
 - (b) 額面金額が同一の取引が複数ある場合には、受渡金額の大きいものから順位付けする。
 - (c) 額面金額及び受渡金額が同一の取引が複数ある場合には、約定日付の古いものから順位付けする。
 - (d) 額面金額、受渡金額及び約定日付が同一の取引が存在する場合の取扱いは、当事者間で確認することで対応する。
- (ハ) (ロ)における順位付けの高い取引から、(イ)の引渡総額と受取総額の内

いずれか小さい方の金額を超えるまで、取引の額面金額を集計する。

(ニ) (イ)の引渡総額と受取総額のいずれか小さい方を構成する全ての取引と、(ハ)で額面金額を集計した取引を対象に異額面のペイメント・ネットティングを行う。

(ホ) (ニ)において、異額面のペイメント・ネットティングの対象外とされた取引は、グロス決済とする。

(注7) 引渡総額及び受取総額は、額面金額で算出する。

(34) 市場全体としての決済量圧縮の観点から、各市場参加者のネットティング導入を一層容易にするため、上記1.に示す「標準的なネットティング・スキーム」の「バイラテラルのペイメント・ネットティング」における「ペアオフ」を前提としたうえで、上記1. の(3)～(56)の項目を当事者間の合意によって変更したネットティングを(以下「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」としていう。)を行うことも可能とする^(注8)。

ただし、この場合においても、決済の円滑性確保等の観点から上記1. の(67)～(10)の項目は、標準的なネットティング・スキームに基づいて行うこととする。

(注8) 例えば、FOP決済のペアオフ、無担保の債券貸借取引同士のペアオフ等がある。

(42) 「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」における法的有効性については、標準的なネットティング・スキームと同様である。

3. 事務手続き

(1) ペア付け及び順位付けの指図

当事者間の合意に基づき、その都度連絡は行わず、ペアオフや異額面のペイメント・ネットティングのペア付け及び順位付けをすることとする。

(2) ネットティングの照合通知

受渡日前営業日の正午午後4時までに両当事者で合意したネットティング対象取引を照合通知書(参考様式1参照)に記載し、相互に同通知書を送付する。照合通知については、「相対ネットティング照合等の実務に関する取扱指針」で定める様式を利用するものとする。

(3) ネットティングの照合時限

受渡日前営業日の午後35時までに照合を完了する。

(4) 照合通知の送付方法

FAX等当事者間の合意に基づく方法を利用する^(注9)。

(注9) 具体的な送付方法の例については、「相対ネットィング照合等の実務に関する取扱指針」を参照。

- (5) 照合通知の確認方法
取引先間相互に行うこととする。
- (6) 異議の通知
内容に異議等がある場合は、受渡日前営業日の午後 35 時まで最終的に正しい照合通知書を送付することにより、照合を完了させることとする。
- (7) 照合部署
原則として、バックオフィス・セクションで行うこととする。
ただし、各市場参加者において、個別の事情に応じて別途の照合部署を指定し、取引相手先に通知を行うことも可能とする。

4. 事前確認書及び事前通知書の参考様式並びに照合通知書との関係

市場参加者は、任意に事前確認書（参考様式 21 参照）及び事前通知書（参考様式 32 参照）を取り交わすこととするが、これらの書面を取り交わすことにより、容易に「標準的なネットィング・スキーム」及び「標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング」を行う際の合意内容、資金決済口座及び担当者名等を確認できる。

事前に当事者間の合意により事前確認書及び事前通知書を取り交わす場合は、次の点に留意して対応する必要がある。

- (1) 事前確認書及び事前通知書は相互に通知し合うことを基本とし、事前に確認した内容と通知された事前確認書及び事前通知書に相違がある場合は、当事者間で再度確認する。
- (2) 事前確認書及び事前通知書並びに照合通知書上に「日本証券業協会の『国債の即時グロス決済に関するガイドライン』の『IV. 二当事者間におけるネットィングに関するガイドライン』に基づいたネットィング」と明記していることから、これらの書面のいずれを用いても「標準的なネットィング・スキーム」及び「標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング」の合意を容易に確認することができる。

なお、照合通知書に押印することは実務上困難であり、記名押印によって合意形成の確認を望む市場参加者にあつては、事前確認書及び事前通知書により確認を行うことが適当と考えられる。

- (3) 事前確認書及び事前通知書を取り交わした場合、同書で確認したネットイングの内容と照合通知書に記載される取引の内容に齟齬が生じることも想定される。その場合の事前確認書と照合通知書の関係については、まず当事者間で直前に確認した結果である照合通知書の内容が優先するが、当事者間で照合通知書に記載された内容に合意できない場合は、事前確認書の内容にしたがって処理することとする。


5. 「バイラテラルのペイメント・ネットイングにおけるペアオフ」以外のネットイングについて

市場参加者間において、「標準的なネットイング・スキーム」によるネットイング、及び「標準的なネットイング・スキームに準じたネットイング」によらず、決済量の圧縮等による事務効率の向上、資金負担の削減が期待できる「バイラテラルのペイメント・ネットイングにおけるペアオフ」以外のネットイング^(注10)を行う旨を合意することも考えられるが、こうしたネットイングの取扱いを行うに当たっては、次の点に留意して対応する必要がある。

(注10) 例えば、集約方式（各当事者が同一銘柄における決済総額を算出し、その差引額を決済する方式）によるペイメント・ネットイング、同一銘柄で額面の異なる国債を差引額で決済する方式によるペイメント・ネットイング及びオブリゲーション・ネットイング（当事者間において履行期を同じくする複数の債権と債務が発生する場合に、新たな債権が発生する都度、履行期の到来を待つことなく債権と債務の差引きを行い、その履行期に履行すべき債権を一本化して決済する方式）がある。

- (1) ネットイングに関しては、差引額相当の国債又は資金の決済について、国債のフェイル又は資金の決済未了が生じる場合も想定する必要がある、国債のフェイル又は資金決済の未了時にどの取引分が対象となるか選別し、どのように対応を行うかといった実務的な点も考慮しなければならない。
- (2) 市場参加者間でネットイング・スキームを取り決めるに当たっては、事務効率だけではなく、RTGS 化の本来の趣旨の1つである決済リスクの削減も十分考慮しなければならない。
- (3) 「バイラテラルのペイメント・ネットイング」以外のネットイングを行うに当たっては、取り決めたネットイング・スキームの法的有効性を当事者間で正確に認識して行う必要がある。なお、~~額面の異なる国債を差引額で決済する等の、同一銘柄におけるペアオフ以外の「バイラテラルのペイメント・ネットイング」に係る法的有効性については、「標準的なネットイング・スキーム」と同様である。~~

XXXXXXXXXX 御中

会社名	XXXX
部署名	XXXX
責任者名	XXXX 
連絡先	XXXX

国債のネットィングに係る事前確認書

日本証券業協会の「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の「IV. 二当事者間におけるネットィングに関するガイドライン」に基づき、貴社と当社の間で行う国債決済のネットィングについて、下記の事項を確認するために本確認書を御送付致します。

1. ネットィングの概要

ネットィングの方法	ガイドラインのIV. 1. で定めるにおける標準的なネットィング・スキーム及び事務手続きにより行うネットィング	
	標準的なネットィング・スキームに準ずるネットィング	
	ガイドラインのIV. 2. (1) 及び(2) で定める標準的なネットィング・スキームに準じた異額面のペイメント・ネットィング	1対1の異額面のペイメント・ネットィング
	ガイドラインのIV. 2. (3) で定める標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング	集約方式の異額面のペイメント・ネットィング

2. 標準的なネットィング・スキームに準ずるネットィングにおける確認事項ガイドラインのIV. 2. (3) で定めるネットィングにおける確認事項 (ガイドラインのIV. 2. (3) で定めるネットィングを行わない場合には記載不要)

対象となる決済数量	標準的なネットィング・スキームに基づくペア・オフ ペア・オフ以外を含む (*詳細はその他補足・追記事項を参照)
対象となる決済方法	標準的なネットィング・スキームに基づくDVP取引同士の決済のみ FOP取引同士の決済のみ DVP取引同士間、FOP取引同士間及びDVP取引、FOP取引の相互間の決済
対象となる取引種別	標準的なネットィング・スキームに基づく売買 (含条件付売買現先) 取引同士、-(現金担保付) 貸借取引同士、及び売買 (含条件付売買現先) 取引・-(現金担保付) 貸借取引の相互間 売買 (含条件付売買現先) 取引同士間のみ -(現金担保付) 貸借取引同士間のみ その他 (例. 無担保貸借取引同士間)
対象となる保有形態	標準的なネットィング・スキームに基づく振替国債同主間のみ 登録国債同主間のみ 振替国債同主間、登録国債同主間および振替国債、登録国債の相互間
対象となる取引の約定照合時限	標準的なネットィング・スキームに基づく受渡日前営業日の約定照合時限の目安 (午後3時30分から午後3時45分) までに約定照合が完了した取引翌午までの約定分 受渡日〇〇〇 (〇時) までの約定照合完了分 ※当該約定照合時限の変更に伴い合意した時限を併記 ネットィングの通知・取消解消時限 受渡日〇〇〇 (〇時) まで ネットィングの照合時限 受渡日〇〇〇 (〇時) まで 異議等の連絡時限 受渡日〇〇〇 (〇時) まで

3. 対象となる口座等

別途、当社から指定した場合を除き、当社口座のすべてを上記確認事項に基づきネットィングする	
以下にあげる口座等	

4. 照合通知の送付方法

--

5. その他補足・追記事項 (ネットィング照合通知データに関する依頼事項等)

その他補足・追記事項

YYYY年MM月DD日

XXXXXXXXXX 御中

会社名	XXXX
部署名	XXXX
責任者名	XXXX (印)
連絡先	XXXX

国債のネットィングに係る事前通知書兼変更連絡書

日本証券業協会の「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の「IV. 二当事者間におけるネットィングに関するガイドライン」に基づき、貴社と当社の間で行う国債決済のネットィングについて、下記の事項（新規・変更）を事前に御連絡致します。

（変更連絡書として使用する場合は、変更を行う項目の番号に○印を付ける。）

記

1. 資金決済口座

日銀資金決済口座	
1	金融機関名（漢字）
2	口座名称
3	口座番号

対象口座により決済口座が異なる場合には、対象となる口座を別途、補足事項欄に記載する。

2. 責任者・担当者および連絡先

1	担当部署名
2	責任者
3	担当者
4	TEL（1）
5	FAX（1）
6	TEL（2）
7	FAX（2）

3. 補足事項欄

適宜、利用

<記入例>日銀当座を原則とし、市中銀行口座は補足事項欄に表記する。

相対ネットィング照合等の実務に関する取扱指針（案）

1. 総論

（1）目的

本取扱指針は、日本証券業協会の「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」（以下「ガイドライン」という。）中の「IV.二当事者間におけるネットィングに関するガイドライン」において定める「バイラテラルのペイメント・ネットィング」（以下「相対ネットィング」という。）について、相対ネットィング照合事務の電子化等の取扱い及び「異額面のペイメント・ネットィング」に関する実務の取扱いを定めることを目的とする。

（2）対象となる取引

本取扱指針の対象となる国債取引は、ガイドラインIV. 1. (5)に定める取引とする
(注1)。

（3）相対ネットィング照合事務の電子化等及び異額面のペイメント・ネットィングの要否

（2）で示す対象取引を活発に行う市場参加者は、ガイドライン及び本取扱指針に沿って、これらの取引に係る相対ネットィング照合事務の電子化等及び異額面のペイメント・ネットィングを行うことが期待される。

① 相対ネットィング照合事務の電子化等

平成 23 年〇月のガイドラインの改正では、照合通知を受領した後、相対ネットィング照合を完了させるまでの時間が、従来の 3 時間から 1 時間に短縮されている。このため、本取扱指針においては、短時間で相対ネットィング照合を完了させる観点から、標準化した照合通知データフォーマット及び照合通知データの電子的な授受の方法を定めている。

(注1) リテール向けの国債販売取引（銀行における窓口販売等）及び非居住者取引は、対象外である。また、決済代行（銀行等が、取引を執行した顧客からの指図に基づき資金・債券の受渡を代理で行う決済形態）については、本取扱指針を参考にしつつ銀行等と顧客との間で個別に事務フローの見直し等を図ることとする。

なお、1. (2)に定める対象取引の取引量が少ないことなどから、照合通知データを電子的に受領しなくとも、照合通知の受領から1時間以内で相対ネットイング照合を完了できると当事者間で判断される場合には、照合通知を電子的に授受する必要はない^(注2)。

② 異額面のペイメント・ネットイング

平成23年〇月のガイドラインの改正では、異額面のペイメント・ネットイングを「標準的なネットイング・スキームに準じたネットイング」として位置付けるとともに、①の相対ネットイング照合事務の電子化等と同様に、短時間で相対ネットイング照合を完了させる観点から、ガイドラインIV.2.(2)にその実施方法を定めている。

ただし、異額面のペイメント・ネットイングの実施は、あくまで当事者間の合意により行うものである。したがって、1.(2)に定める対象取引の取引量が少ないことなどから、異額面のペイメント・ネットイングを実施しなくとも、決済が円滑に行われると当事者間で判断される場合には、異額面のペイメント・ネットイングを実施する必要はない。

2. 照合通知データフォーマットの標準化

ガイドラインIV.3.(2)に定める照合通知の様式（以下「照合通知データフォーマット」という。）の作成及び送受信等の取扱いは、以下の①から⑤を標準とする。

①データ項目

- 照合通知データフォーマットのデータ項目は、別紙1を標準とする。

②ファイル形式

- 照合通知データのファイル形式は、Excel形式又はCSV形式を標準とする。

(拡張子等)

- ・ Excel形式は、Excel97からExcel2003に互換性のある形式（拡張子が.xlsであ

(注2) この場合、平成22年11月版ガイドラインに記載されているように、FAX等を利用して照合通知書（参考様式、別紙2参照）を送付することが想定される。

るもの)を標準とする。

- ・ CSV形式は、可変長のカンマ区切りを標準とする。なお、CSV形式は、Webサービスの利用により照合通知データの授受を行う場合等を想定しており、電子メールによりパスワードを付して照合通知データを送信する場合には、ファイルを圧縮し、圧縮したファイルにパスワードを付さない限り CSV形式は取り得ない。

○ 当事者間で合意した場合には、照合通知データのファイルを圧縮することができる。

(圧縮形式)

- ・ 照合通知データのファイルを圧縮する場合には、圧縮形式(.zip形式、.lzh形式等)やパスワードの有無等、当事者間で予め合意しておくこととする。

③ファイル名称

○ 照合通知データのファイル名称は、「会社名(ファイル送信側)＋会社名(ファイル受信側)＋決済日(yyyymmdd)＋_(アンダーバー)＋枝番(任意)」とする。

- ・ 会社名は、金融機関コード(決済照合システムで使用するBICコード(支店コード除く)、又は冒頭に金融・証券区分コード(「0」又は「1」)を付した統一金融機関番号又は証券会社等標準コード(計5桁))を用いる。
- ・ 原則として、ペアオフ及び異額面のペイメント・ネットィングの照合通知データは1つのファイルで送付する。複数のファイルを送信する場合には、枝番を付すこととする。

④セキュリティ

○ 照合通知データのファイルを電子的に授受する際には、パスワードの設定を標準とし、パスワードの設定ルールは、当事者間で合意した任意の方法とする(以下の例を参照)。なお、当事者間で合意した場合には、暗号化を行うことができる。

(パスワードの設定ルールの例)

- ・ パスワードの設定ルールには、以下の方法が考えられる。

- ▶ 固定パスワード（パスワードの変更を行わない方法）
- ▶ 定期的変更（1 カ月単位等で定期的に変更する方法）
- ▶ 日々変更（パスワードの一部又は全部を毎日変更する方法）
- ▶ 個別設定（送信の都度、受信者に電話等で連絡する方法）

⑤照合通知データの送受信の頻度

- 照合通知データの送受信は、1 日 1 回とする。

3. 照合通知データの電子的な授受の方法

照合通知データの電子的な授受の方法については、事務上の混乱が生じないよう当事者間で予め十分に確認しておくことが推奨される。電子的なデータ授受手段の例としては、以下のものが考えられる。

- ・ Web サービス^(注3)
- ・ 電子メール

4. 異額面のペイメント・ネッティング

ガイドラインに定める「標準的なネッティング・スキームに準じたネッティング」として、異額面のペイメント・ネッティングを行う場合には、当事者間でガイドラインIV.4.に定める事前確認書を取り交わすなどの方法により、当事者間で合意する必要がある。なお、事前確認書を取り交わすことにより、異額面のペイメント・ネッティングを行う場合には、「1対1の異額面のペイメント・ネッティング」又は「集約方式の異額面のペイメント・ネッティング」のいずれの方法を選択するか、当事者間で事前に確認を行い、合意することとなる。

以 上

^(注3) Web サービスを利用する際に、当該 Web サービスの提供ベンダーに確認することが望ましい事項については、別紙3 参照。

ネットイング通知データ(項目定義書)

【CSV形式】 ※Excel形式の場合には別途定義要。

項番	項目名称	桁数	タイプ	単位	表示方法	セット内容	設定方法 (◎必須、▲任意設定)	サンプル	備考
1	SEQ	4	数字	—	9999	送信ファイル内でのSEQ番号	◎	0001	
2	取引業者	4	数字	—	9999	日銀ネット上の「金融機関等コード」	◎	0324	決済代行先へ送付する場合、取引業者欄には実際の決済相手(項番7「貴社国債決済口座」の頭4桁)
3	受渡日	8	数字	—	yyyymmdd	当該取引の受渡日	◎	20100706	
4	明細・合計区分	1	数字	—	9	ネットイング後の合計は「1」 ネットイング元の明細は「2」	◎	1	
5	保有形態	1	数字	—	9	固定値:1	◎	1	1=振込
6	貴社資金決済口座	7	数字	—	9999999	日銀当座預金コード	◎ (備考欄参照)	1234001	項番13「資金決済金額」がゼロになる取引の場合には任意設定。(国債決済のみのデータとなるため照会対象外項目。)
7	貴社国債決済口座	8	数字	—	99999999	日銀国債決済コード	◎ (備考欄参照)	12340001	項番14「国債決済金額」がゼロになる取引の場合には任意設定。(資金決済のみのデータとなるため照会対象外項目。)
8	当社資金決済口座	7	数字	—	9999999	日銀当座預金コード	◎ (備考欄参照)	7890001	項番13「資金決済金額」がゼロになる取引の場合には任意設定。(国債決済のみのデータとなるため照会対象外項目。)
9	当社国債決済口座	8	数字	—	99999999	日銀国債決済コード	◎ (備考欄参照)	78900001	項番14「国債決済金額」がゼロになる取引の場合には任意設定。(資金決済のみのデータとなるため照会対象外項目。)
10	照会番号	—	英数字	—	x---x	作成側での自動採番 (同じ番号であれば同一ネットイングに対してという意)	◎	60545000	不一致等での照会用
11	貴社決済種別	1	数字	—	9	1. 資金受取、2. 資金支払、 3. DVP(売)、4. DVP(買)、 5. FOP(売)、6. FOP(買)、 7. 資金受取・FOP(買)、8. 資金支払・FOP(売)、 9. 資金・国債とも決済なし	◎	3	
12	決済時限	4	数字	—	9999	決済時限がある場合には時間を設定。指定なしの場合には「即時:0000」を設定。	◎	1500	
13	資金決済金額	—	数字	円	9---9	該当取引の資金決済金額(正数で表示)	◎	1010000000	頭ゼロ埋めなし。項番11「貴社決済種別」が「5」、「6」、「9」である場合は、0(ゼロ)とする。
14	国債決済金額	—	数字	円	9---9	該当取引の国債決済金額(正数で表示)	◎	1000000000	頭ゼロ埋めなし。項番11「貴社決済種別」が「1」、「2」、「9」である場合は、0(ゼロ)とする。
15	信託銀行ファンドNO	—	英数字	—	x---x	ファンド番号19桁で左詰め 信託銀行との取引の場合必須	対信託取引◎ (それ以外▲)	ABCDEFGHI5000000001	
16	銘柄名称	—	英数カナ漢字	—	k---k	銘柄名称	▲	利国債10年297カイ	
17	銘柄コード	12	英数字	—	JPxxxxxxxxxx 999999999	ISINコード(12桁)又は日銀銘柄コード(9桁)	◎	111029700	
18	約定日	8	数字	—	yyyymmdd	当該取引の約定日	▲	20100704	項番4「明細・合計区分」が「1」であるデータの場合には任意設定。(ブック8桁セット有無についても任意。ネットイング後の合計データにおいては照会対象外項目。)
19	記事欄	—	英数字	—	x---x	通常の決済データにセットしている記事欄をそのまま使用する。 (決済代行を利用している場合も決済代行委託元の情報 セット仕様あり)	対信託取引◎ (それ以外▲)	***現状通り***	決済代行を利用している場合、3~9桁目および18~24桁目へ、決済代行委託元のコードセットなどを行う。(本項、または項番22か項番23への設定を行うなどの方法で、決済代行委託元を特定)
20	メッセージ欄	—	英数字カナ	—	x---x	メッセージ記入欄	▲	ツイカヤクソウブン	
21	備考欄	—	英数字カナ	—	x---x	作成者が必要とする事項について記入	▲	5000000001	
22	決済代行委託元(受方)	—	英数字カナ	—	x---x	当事者間で合意した内容を記入	▲	SC1234	
23	決済代行委託元(渡方)	—	英数字カナ	—	x---x	当事者間で合意した内容を記入	▲	BA9876	本項を使用する場合、日銀電文上にセットする記事の「B」または「O」の部分を除いたものを記入するなど当事者間で合意した方法で、決済代行委託元を特定。

ネットワーキング通知書データ(設定例)

【前提】

決済当事者A(信託銀行:日銀ネット上の「金融機関等コード」:1234)と決済当事者B(証券会社:日銀ネット上の「金融機関等コード」:7890)との間の3月10日の決済における相対ネットワーキング照合通知の事例。

なお、3月10日受渡の取引は以下の通り(ファンドABCDEFGHI5000000001は信託口Ⅰ、ABCDEFGHI5000000002は信託口Ⅱのファンド、信託銀行Aは購入時ITCを使用)

A選L受付けの取引

約定日	銘柄	額面(千円)	受渡金額(円)	信託銀行ファンド番号	約定日	銘柄	額面(千円)	受渡金額(円)	信託銀行ファンド番号
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	5,000,000	5,200,000,000	ABCDEFGHI5000000001	3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	5,000,000	5,000,000,000	ABCDEFGHI5000000001
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	5,000,000	5,100,000,000	ABCDEFGHI5000000001	3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	5,000,000	4,900,000,000	ABCDEFGHI5000000001
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	5,000,000	4,900,000,000	ABCDEFGHI5000000001	3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	4,500,000	4,400,000,000	ABCDEFGHI5000000001
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	4,000,000	4,100,000,000	ABCDEFGHI5000000001	3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	3,500,000	3,400,000,000	ABCDEFGHI5000000001
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	3,000,000	3,100,000,000	ABCDEFGHI5000000001	3月9日	利付国庫債券(10年)第297回	1,000,000	900,000,000	ABCDEFGHI5000000001
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	2,500,000	2,600,000,000	ABCDEFGHI5000000001	3月9日	利付国庫債券(10年)第297回	1,000,000	1,100,000,000	ABCDEFGHI5000000002
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	2,500,000	2,400,000,000	ABCDEFGHI5000000001	3月8日	国庫短期証券第165回	5,000,000	5,000,000,000	ABCDEFGHI5000000002
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	1,500,000	1,400,000,000	ABCDEFGHI5000000001	3月8日	国庫短期証券第165回	4,000,000	4,000,000,000	ABCDEFGHI5000000002
3月8日	利付国庫債券(10年)第297回	500,000	600,000,000	ABCDEFGHI5000000001					
3月8日	国庫短期証券第165回	5,000,000	5,000,000,000	ABCDEFGHI5000000002					
3月8日	国庫短期証券第165回	5,000,000	5,000,000,000	ABCDEFGHI5000000002					

B選L受付けの取引

決済当事者A→決済当事者Bへ送付するネットワーキング通知データの設定例

SEQ	取引業者	受渡日	明細・合計区分	保有形態	貴社資金決済口座	貴社国債決済口座	当社資金決済口座	当社国債決済口座	照会番号	貴社決済種別	決済時期	資金決済額	国債決済額	信託銀行ファンドNO	銘柄名称	銘柄コード	約定日	記事欄	メッセージ欄	備考欄	決済代行委託元(受方)	決済代行委託元(渡方)	
0001	7890	20110310	1	1	7890001	7890001	1234001	12340101	60545690	2	1500	2000000000	0	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700							
0002	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340101	60545690	4	1500	5200000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	OABCDEFGHI5000000001					
0003	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340001	60545690	3	1500	5000000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0004	7890	20110310	1	1	7890001	7890001	1234001	12340101	60545691	2	1500	2000000000	0	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700							
0005	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340101	60545691	4	1500	5100000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	OABCDEFGHI5000000001					
0006	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340001	60545691	3	1500	4900000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0007	7890	20110310	1	1	7890001	7890001	1234001	12340201	60545692	9	1500	0	0	ABCDEFGHI5000000002	短期証券165回	161001650							
0008	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340201	60545692	4	1500	5000000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000002	短期証券165回	161001650	20110308	OABCDEFGHI5000000002					
0009	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340001	60545692	3	1500	5000000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000002	短期証券165回	161001650	20110308	BABCDEFGHI5000000002					
0010	7890	20110310	1	1	7890001	7890001	1234001	12340101	60545703	4	1500	2300000000	2000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700							
0011	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340101	60545703	4	1500	4900000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	OABCDEFGHI5000000001					
0012	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340101	60545703	4	1500	4100000000	4000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0013	7890	20110310	1	1	7890001	7890001	1234001	12340101	60545703	4	1500	3100000000	3000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	OABCDEFGHI5000000001					
0014	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340001	60545703	3	1500	4400000000	3500000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0015	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340001	60545703	3	1500	3400000000	3500000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0016	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340001	60545703	3	1500	9000000000	10000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110309	BABCDEFGHI5000000001					
0017	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340001	60545703	3	1500	11000000000	10000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110309	BABCDEFGHI5000000001	ツカヤクゴアツ				
0018	7890	20110310	1	1	7890001	7890001	1234001	12340201	60545705	4	1500	10000000000	10000000000	ABCDEFGHI5000000001	短期証券165回	161001650							
0019	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340201	60545705	4	1500	5000000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	短期証券165回	161001650	20110308	OABCDEFGHI5000000002					
0020	7890	20110310	2	1	7890001	7890001	1234001	12340001	60545705	3	1500	4000000000	4000000000	ABCDEFGHI5000000001	短期証券165回	161001650	20110308	BABCDEFGHI5000000002					

決済当事者B→決済当事者Aへ送付するネットワーキング通知データの設定例

SEQ	取引業者	受渡日	明細・合計区分	保有形態	貴社資金決済口座	貴社国債決済口座	当社資金決済口座	当社国債決済口座	照会番号	貴社決済種別	決済時期	資金決済額	国債決済額	信託銀行ファンドNO	銘柄名称	銘柄コード	約定日	記事欄	メッセージ欄	備考欄	決済代行委託元(受方)	決済代行委託元(渡方)	
0001	1234	20110310	1	1	1234001	12340101	7890001	78900001	50234000	1	1500	2000000000	0	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700							
0002	1234	20110310	2	1	1234001	12340001	7890001	78900001	50234000	4	1500	5000000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0003	1234	20110310	2	1	1234001	12340101	7890001	78900001	50234000	3	1500	5200000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	OABCDEFGHI5000000001					
0004	1234	20110310	1	1	1234001	12340101	7890001	78900001	50234002	2	1500	2000000000	0	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700							
0005	1234	20110310	2	1	1234001	12340001	7890001	78900001	50234002	4	1500	4900000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0006	1234	20110310	2	1	1234001	12340101	7890001	78900001	50234002	3	1500	5100000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	OABCDEFGHI5000000001					
0007	1234	20110310	1	1	1234001	12340201	7890001	78900001	50234004	9	1500	0	0	ABCDEFGHI5000000002	短期証券165回	161001650							
0008	1234	20110310	2	1	1234001	12340001	7890001	78900001	50234004	4	1500	5000000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000002	短期証券165回	161001650	20110308	BABCDEFGHI5000000002					
0009	1234	20110310	2	1	1234001	12340201	7890001	78900001	50234004	3	1500	5000000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000002	短期証券165回	161001650	20110308	OABCDEFGHI5000000002					
0010	1234	20110310	1	1	1234001	12340101	7890001	78900001	50234101	3	1500	2300000000	2000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700							
0011	1234	20110310	2	1	1234001	12340001	7890001	78900001	50234101	4	1500	4400000000	4500000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0012	1234	20110310	2	1	1234001	12340001	7890001	78900001	50234101	4	1500	3400000000	3500000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	BABCDEFGHI5000000001					
0013	1234	20110310	1	1	1234001	12340101	7890001	78900001	50234101	4	1500	8000000000	10000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110309	BABCDEFGHI5000000001					
0014	1234	20110310	2	1	1234001	12340001	7890001	78900001	50234101	4	1500	11000000000	10000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110309	BABCDEFGHI5000000001	ツカヤクゴアツ				
0015	1234	20110310	2	1	1234001	12340101	7890001	78900001	50234101	3	1500	4900000000	5000000000	ABCDEFGHI5000000001	利国債10年297回	111029700	20110308	OABCDEFGHI5000000001					
0016	1234	20110310	2	1	1234001	12340101	7890001	78900001	50234101	3	1500</												

XXXXXXXX 御中

会社名	XXXX
部署名	XXXX
TEL	XXXX
FAX	XXXX
TEL (2)	XXXX
FAX (2)	XXXX

国債のネットिंगに係る照合通知書

日本証券業協会の「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」の「IV. 当事者間におけるネットिंगに関するガイドライン」に基づき、貴社と当社の間で行う国債決済のネットिंगの内容を確認するため、本通知書を御送付致しますので、内容を御確認下さい。

受渡日YYYY年MM月DD日

貴社資金決済口座		当社資金決済口座	
金融機関名		金融機関名	
口座名称		口座名称	
口座番号		口座番号	

保有形態	振替国債
------	------

ネットिंग明細			原約定明細					
ネットिंग No.	貴社の 支払/受取	受渡金額 (円)	銘柄名	貴社証券受入取引	決済方法	支払受渡金額	約定日	額面(千円)
				貴社証券引渡取引	決済方法	受入受渡金額	約定日	額面(千円)
1	支払	AA, AAA, AAA	123利付国庫債券	買	DVP	B, BBB, BBB, BBB	YYYY-MM-DD	b, bbb, bbb
				貸	DVP	C, CCC, CCC, CCC	YYYY-MM-DD	C, CCC, CCC
2								
3								
4								
5								
6								
7								
8								
9								
10								

取引区分を記載
例)
買…取引先の買
売…取引先の売
貸…取引先の貸付
借…取引先の借入
貸返…取引先の貸付返済
借返…取引先の借入返済

<記入例> 日銀当座を原則とし、市中銀行口座は適宜、記入欄を増やして利用する。

Webサービス利用に係る提供ベンダーへの確認事項

《利用の前提等》

- Webサービス提供にあつては、一般に利用者全体で①最低利用者数（利用ID数）の確保、②利用データ容量（〇〇ギガバイト）上限が求められる。
- 今回のWebサービスでは、利用者側に運営主体が存在せず、上記①、②を各利用者がコミットすることもできないことから、提供事業者による事業提供の判断材料を提供する必要がある。（提供事業者の事業判断でWebサービスが提供されること）
- 利用者は個別にWebサービス提供事業者へ申し込むこととなるが、利用方法（出来通知データ授受、照合通知データ授受）がパターン化されており、効率的に利用の判断が出来る様、共通的なサービス内容確認項目の整理を行うもの。

《確認項目》（◎は必須項目、○は標準サービスが望ましい項目、●は確認項目）

確認項目	確認内容	A社	B社
(1) WebのID運営管理	<ul style="list-style-type: none"> ● WebのID等の管理（各社、各社代表者）はどのように行われるか（運営者自体が行うか、ユーザーで社内の権限管理か）。 ● ユーザーの利便面では、運営者がID付与、各IDの権限管理を行うほうが望ましい（異動等の場合の変更負荷が軽い）。 ● ファイル、フォルダの参照権限はだれが管理設定するか（新規、変更等）。 ● 相手先利用者の変更等を機動的に行なう上では、ユーザーにもファイル、フォルダの参照権限が付与されることが望ましい。（管理規定は必要） 	<ul style="list-style-type: none"> ● ユーザIDとして個人のメールアドレスを利用。ユーザIDの登録・変更・削除は、弊社管理者が実施。ユーザID登録時に、初期パスワードをユーザへ送信。ユーザが初期パスワードを使用してログインし、その後各自のパスワードに変更。パスワードはユーザが管理。 ✓ フォルダの参照権限は、フォルダ作成者（通常、弊社管理者またはフォルダの編集者）が設定。ファイルの参照権限は、フォルダの参照権限が引き継がれるが、ファイル毎にファイルの編集者が設定することも可能。 	<ul style="list-style-type: none"> ● 弊社がIDを払い出し（申込は10ID単位、未使用IDは追加申し込みで弊社が設定） ● セルサイド（出来通知データの出し手）1社毎にフォルダ（電子会議室）権限設定可能な階層を払い出し。 ● トップ階層権限を有する会社のユーザーがフォルダ（会議室）新設の際に、関係する参照権限を付与。
(2) 情報セキュリティの確保	<p>◎情報のセキュリティ確保は担保されていること。（暗号化技術、外部機関の認証（SAS70等）等）</p> <p>○たとえば国内における金融機関のシステム安全基準等に適合しているか（FISC等）。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● データ送信は、使用可能な商用暗号化水準での最高レベルのひとつ、最大128ビットに暗号化。データセンタ内では、データは暗号化され保管。厳格な第三者による検査および頻繁な監査で、すべての情報の安全な保管・転送を保証。データセンタは、アメリカの会計監査基準であり、統制の機能と遵守を明示するSAS70タイプII認証を取得。 	<ul style="list-style-type: none"> ● 不正操作監視（弊社側関係者の「持ち込み、持ち出しファイル、ログイン履歴、操作履歴」等の証跡監査及び保管を行っている） ● ネットワーク制御—ファイヤーウォールを用いて不正なアクセスを遮断 ● 盗聴対策—ユーザー・サーバー間はSSL対応 ● 監視保守は24時間、365日有人監視、障害にリアルタイム対応 ● 外部認証機関（ISMS（ISO27001）、BCMS 認証 BS25999-2:2007）
(3) 運営サポート体制	<p>◎当初、利用開始時の画面設定、参照権限設定等のサポートは適切に行われるか。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● カスタマーサービスによるサポート方法（オンサイト、電話、メールその他） <p>◎照会（ID付与者）に対するカスタマーサポートは適切に行われるか。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● ID、セキュリティ、オペレーション、エラー対応等が直接、サポートされるか。 	<ul style="list-style-type: none"> ● 弊社カスタマーサポートデスクがオンサイト、電話・メールによりサポート。 ● 各種問合せ対応、およびその後のフォローアップ対応。 <ul style="list-style-type: none"> ・パスワードがわからなくなった ・ユーザがロックされた ・初期交付したパスワードが期限切れになった ・オペレーション方法がわからない ・バウンスバック：送信したメールがアドレス不正で戻ってきた場合の調査および必要に応じたアドレス修正 ・クローズマッチ（企業情報マッチングとユーザ名寄せ） ・似た会社名、アドレスなどで複数ユーザが登録されている場合などの確認 	<ul style="list-style-type: none"> ● 利用開始時の画面設定、参照権限設定は弊社で実施。 ● 照会は、標準的にはエンドユーザーの直接窓口なし。 ● 各社代表者1名からのサービス窓口（メール）対応 平日 9:30～18:00

<p>(4) 運営サポート (続き)</p>	<p>◎照会対応時間帯、日本語対応の時間帯 (*)、時間外の緊急対応の場合に日本語対応可能か。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●営業時間帯 (朝9時から18時ころ) をカバーしていること。 ●本邦金融機関の営業日 (年末:12月30日まで、年始:1月4日から)、営業時間帯 (朝9時から18時ころ) をカバーしていること。 <p>○海外を含む複数オフィス・拠点の利用可能なことが望ましい。その場合のサポート時間帯とサポート言語 (日本語、英語) は可能か。(マスト事項ではないが)</p> <ul style="list-style-type: none"> ●ユーザーマニュアルも英語、日本語が利用可能なことが望ましい。 	<ul style="list-style-type: none"> ●日本時間 9:00~21:00 (土日祝日および年末年始を除く) 12/30、1/4の年末年始サポートも対応可能。 <p>現時点では日本のカスタマーサポートデスク以外の利用不可であるが、今後、サービスレベル拡大の予定あり。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ●日本語対応のみ。 <p>照会対応は弊社営業日 (平日の場合12月28日まで、1月4日から) の対応</p> <p>メール回答の場合、1次回答は2~3時間以内を想定。電話対応、開局時間見直しは、ユーザー規模数を踏まえ検討。</p> <p>画面表示は英語対応。</p>
<p>(5) 提供機能</p>	<p>○データ送信先(相手)がダウンロードやファイル開封した場合の通知機能はあるか。(送信者が画面で確認できるか)</p> <ul style="list-style-type: none"> ●マスト事項ではないが、標準サービスが望ましい。 <p>○フォルダーへのファイルアップロード機能が提供可能か。(オプション利用の場合の追加利用料等)</p>	<p>通知機能はなし。</p> <p>送信者がWebサービスにアクセスし、データ送信先の閲覧状況を確認可。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ●当該画面を表示したかは確認可能。添付ファイルの開封、ダウンロードの確認機能はなし。
<p>(6) 障害対応</p>	<p>◎サーバーダウン、回線障害等、障害発生時のサポートや代替策は用意されているか。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●リカバリーに要する時間はどの程度必要と想定しているか(同一センター内での障害発生の場合、拠点切り替えの場合等、実務影響確認のため) ●過去の障害発生事例はあるか。 ●可用性(例えば99.5%以上)の保証外として想定される事象(0.5%) はどのような事象か。 	<ul style="list-style-type: none"> ●データセンタ全体でのリアルタイム・レプリケーションにより、データの完全性と信頼性を保証。 <p>先進の保管技術、包括的なバックアップ戦略とデータ回復ソリューションにより、緊急事態でも処理の継続が確実に、99.5%の可用性を保証。</p> <p>洗練されたファイアウォール、ウイルススキャン・検出ソフトウェアを導入し、経験豊富なセキュリティ専門家、エンジニア、品質保証スペシャリストによる24時間365日のシステム監視を実施。</p> <p>冗長ネットワーク、予備電源、最新鋭の監視システムの他、「ベストプラクティス」の業務対策により、予期せぬ事象に対して防御。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ●サーバ、回線すべて冗長化されており、サービス全体でシングルポイントはなし。 ●ディザスターリカバリーはなし (データセンターは1か所) ●データバックアップは日次実施、ハード障害時もデータ復旧可能 ●過去 (2010年4月のサービス開始以来)、障害発生はなし。
<p>(7) 利用コスト試算</p>	<p>◎利用者を募る上で、利用コストの明示が必要なため、コストシュミレーションの前提の提示が必要。(以下は前提例)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・証券会社30社、機関投資家20社、信託銀行5行が各々10ID利用 (最低150程度の利用を想定) ・証券会社1社のファイル送信20回/日、機関投資家のファイル送信40回/日、 ・ネットィング照合は、各社1回/日 ・その他、算定に必要な条件 (データ保存期間等) <ul style="list-style-type: none"> ●利用コスト (課金体系) はどのように設定されるか (固定、従量制等)。(課金体系を考えるポイント) ●Webサービスの利用者全体で、利用データ容量上限管理できないため、利用者の公平性を確保する上で、ID当たりの利用データ容量上限 (例えば10MB) 設定が望ましい。 <p>◎利用が暫定対応の位置づけであることから利用コストは安価なことが必要。(1利用ID1万円/年間程度)</p>	<ul style="list-style-type: none"> ●社内調整中 	<ul style="list-style-type: none"> ●社内調整中。 <ul style="list-style-type: none"> ●1CSVファイルあたり数キロバイト、1IDあたり10MBの想定。 ●月額ID単位の従量制課金を想定、申し込みは10ID単位。

(8) その他	◎事業者がサービス内容の変更（料金変更等）や、停止する場合、事前通知期間（停止の場合は1年前等）が確保されていること。		
---------	-------------------------------------------------------------	--	--

以上

『国債の即時グロス決済に関するガイドライン』及び『フェイルチャージの実務に関する取扱指針』に基づく決済についてのQ & A」改訂案

Q		A									
番号	内容										
14	RTGSにもかかわらず、なぜネットティング慣行を策定したのですか。	現行のAと同じ									
15	平成23年●月に、「IV. 二当事者間におけるネットティングに関するガイドライン」が改正された趣旨はどこにありますか。	<p>A：平成24年4月より、アウトライイトT+2化（国債の売買取引にかかる受渡し・決済を原則として売買約定日から起算して3営業日目に行うこと）が実施されます。その際には、「IV. 二当事者間におけるネットティングに関するガイドライン」で規定されている「バイラテラルのペイメント・ネットティング」（以下「相対ネットティング」という。）の照合通知の送付時限が4時間繰下げられるほか、相対ネットティングの照合時限が2時間繰下げられます。したがって、照合通知を受領した後、相対ネットティング照合を完了させるまでの時間が、従来の3時間から1時間に短縮されることとなります。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>改正前</th> <th>アウトライイトT+2化実施後</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>照合通知の送付時限</td> <td>受渡日前営業日の正午</td> <td>受渡日前営業日の午後4時</td> </tr> <tr> <td>ネットティングの照合時限</td> <td>受渡日前営業日の午後3時</td> <td>受渡日前営業日の午後5時</td> </tr> </tbody> </table> <p>このため、短時間で相対ネットティング照合を完了させる観点から、相対ネットティング照合事務の標準化や電子化を進めることとなりました。具体的に、「国債の決済期間の短縮化に関する検討ワーキング・グループ」における検討では、「相対ネットティング照合等の実務に関する取扱指針」において、標準化した照合通知データフォーマットや照合通知データの電子的な授受の方法を定めるとともに、「異額面のペイメント・ネットティング」を「標準的なネットティング・スキームに準じたネットティング」と位置付けたうえで、その実施方法を定めることが適当とされました。</p> <p>(ガイドラインIV. 3. 「事務手続き」、相対ネットティング照合等の実務に関する取扱指針1. (3)「相対ネットティング照合事務の電子化等及び異額面のペイメント・ネットティングの要否」参照)</p>		改正前	アウトライイトT+2化実施後	照合通知の送付時限	受渡日前営業日の正午	受渡日前営業日の午後4時	ネットティングの照合時限	受渡日前営業日の午後3時	受渡日前営業日の午後5時
	改正前	アウトライイトT+2化実施後									
照合通知の送付時限	受渡日前営業日の正午	受渡日前営業日の午後4時									
ネットティングの照合時限	受渡日前営業日の午後3時	受渡日前営業日の午後5時									
16	相対ネットティング照合を行う場合には、照合通知データを当事者間で電子的に授受する必要がありますか。	<p>A：Q15に記載のとおり、アウトライイトT+2化実施後は、照合通知を受領した後、相対ネットティング照合を完了させるまでの時間が、従来の3時間から1時間に短縮されます。このため、ネットティング照合事務の標準化や電子化を進めることとなりました。</p> <p>したがって、国債の売買取引（条件付売買取引を含む。）及び現金担保付貸借取引（以下「対象取引」という。）を活発に行う市場参加者は、短時間で相対ネットティング照合を完了させる観点から、標準化された照合通知データフォーマットを用いて、電子的に照合通知データの授受を行うことが期待されます。ただし、対象取引の取引量が少ないことなどから、照合通知データを電子的に受領しなくとも、照合通知の受領から1時間以内で相対ネットティング照合を完了できると当事者間で判断される場合には、照合通知を電子的に授受する必要はありません。</p> <p>(ガイドラインIV. 3. 「事務手続き」、相対ネットティング照合等の実務に関する取扱指針1. (3)「相対ネットティング照合事務の電子化等及び異額面のペイメント・ネットティングの要否」参照)</p>									
17	「相対ネットティング照合等の実務に関する取扱指針」の3. では、照合通知データの電子的な授受の方法の例として、Web サービスまたは電子メールが挙げられています。Web サービスまたは電子メールを利用して照合通知データを電子的に授受する際に留意する点は何ですか。	<p>A：Web サービスまたは電子メールを利用して照合通知データを電子的に授受する際には、事務上の混乱が生じないように、利用するサービスまたは電子メールアドレス等電子的な授受の方法の詳細について、当事者間で予め十分に確認しておくことが推奨されます。</p> <p>なお、「国債の決済期間の短縮化に関する検討ワーキング・グループ」における検討では、セキュリティの面で、Web サービスによるデータの授受がより望ましいとの整理が行われています。</p> <p>(相対ネットティング照合等の実務に関する取扱指針3. 「照合通知データの電子的な授受の方法」参照)</p>									
18	Web サービスはどのようなものを想定していますか。	<p>A：ITベンダーが提供するクラウド型サービス（インターネットを通じITベンダーが用意するサービスの提供を受ける形態）で、現在、契約情報や設計書等を特定の利用者間で交換する手段や、グループウェアの会議室機能を応用したもの等が想定されています。いずれも一定のセキュリティが確保され、ID、パスワードで権限が与えられた先のみが、Web画面を通じ特定の情報にアクセスできるものを想定しています。</p> <p>なお、利用にあたっては、各市場参加者において、こうした機能を提供するITベンダーと個別に具体的な利用方法等について協議の上、契約を行う必要があります。「相対ネットティング照合等の実務に関する取扱指針」の別紙3では、Webサービスを提供するITベンダーに確認することが望ましい事</p>									

		<p>項を示しています。</p> <p style="text-align: right;">(相対ネットリング照合等の実務に関する取扱指針別紙2参照)</p>
19	市場参加者は、異額面のペイメント・ネットリングを行う必要がありますか。	<p>A：市場全体としての決済量の圧縮等による事務効率の向上、資金負担の削減の観点から、対象取引を活発に行う市場参加者は、異額面のペイメント・ネットリングを行うことが期待されます。ただし、異額面のペイメント・ネットリングは、ガイドラインにおいて「標準的なネットリング・スキームに準じたネットリング」に位置付けられています。したがって、市場参加者間において、異額面のペイメント・ネットリングを実施する場合には、ガイドラインⅣ. 4. に定める事前確認書を取り交わすなどの方法により、当事者間で合意する必要があります。</p> <p>なお、対象取引の取引量が少ないことなどから、異額面のペイメント・ネットリングを実施しなくとも、決済が円滑に行われると当事者間で判断される場合には、異額面のペイメント・ネットリングを実施する必要はありません。</p> <p style="text-align: right;">(相対ネットリング照合等の実務に関する取扱指針1.(3)「相対ネットリング照合事務の電子化等及び異額面のペイメント・ネットリングの要否」参照)</p>
20	集約方式の異額面のペイメント・ネットリングのやり方を示してください。	A：別紙をご参照ください。
21	異額面のペイメント・ネットリングを行った場合の決済日に留意する点は何ですか。	<p>A：異額面のペイメント・ネットリングは、①ネットリング戻の決済未履行時には債権債務の関係を原約定のとおりに戻す合意を行っていること、及び②国債と資金のネットリング戻の決済の履行によりネットリングが成立すること等については、ペアオフと異なりません。</p> <p>したがって、集約方式の異額面のペイメント・ネットリングについて、国債のネットリング戻の決済が未履行（フェイル）となったときは、異額面のペイメント・ネットリングの対象となった全ての取引の債権債務の関係が原約定のとおりに戻されます。このため、当事者間の合意により集約方式の異額面のペイメント・ネットリングを行った場合には、フェイルの影響を最小化すると同時に、決済の進捗度を高める観点から、当事者間で決済順位について調整しつつ、大口決済と同様にネットリング戻の決済を優先して行なうことが適当と考えられます。</p>
22	集約方式の異額面のペイメント・ネットリングを行った場合に、国債のネットリング戻の決済が未履行（フェイル）となったときは、どのように対応すればよいですか。	A：Q21に記載のとおり、集約方式の異額面のペイメント・ネットリングを行った場合に、国債のネットリング戻の決済が未履行（フェイル）となったときは、異額面のペイメント・ネットリングの対象となった全ての取引の債権債務の関係が原約定のとおりに戻されます。市場参加者は、この状態を解消するため、取引相手方の国債の保有状況や未履行となった時間帯等を考慮し、巻き戻された取引をグロス決済とするか、再度ネットリングを行うか等について協議し、フェイルを可能な限り回避することが求められます。
23	電子化推進の観点では、ネットリング照合通知だけでなく、受渡日前日の決済金額照合など幅広い電子化推進が必要ではないですか。	A：受渡日前日の決済金額照合については個別に行なわれているものであり、今回の標準化検討の対象外としています。しかしながら、円滑な決済を確保する観点からは効率的なポストトレード事務が求められるところであり、市場参加者各位においてペーパーレス化、電子的処理推進の検討が望まれるところです。なお、将来（2015年以降）、保振決済照合システムと日銀ネットの決済連動の実現や今後のアウトライイトT+1化検討による見直しも期待されます。

集約方式の異額面のペイメント・ネットティングの実施方法

- 「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」Ⅳ. 2. (2)に定める集約方式の異額面のペイメント・ネットティングは、次の手順により行います。
- 以下では、国債の渡し方及び国債の受け方となっている取引の具体例を次のとおりとします。また、取引①～⑮は、全て同一銘柄の取引です。

【具体例】

国債の渡し方となっている取引			国債の受け方となっている取引		
取引	額面	受渡金額	取引	額面	受渡金額
①	50 億円	52 億円	⑩	50 億円	50 億円
②	50 億円	51 億円	⑪	50 億円	49 億円
③	30 億円	31 億円	⑫	45 億円	46 億円
④	40 億円	41 億円	⑬	35 億円	36 億円
⑤	5 億円	6 億円	⑭	10 億円	9 億円
⑥	50 億円	49 億円	⑮	10 億円	11 億円
⑦	15 億円	14 億円			
⑧	25 億円	26 億円			
⑨	25 億円	24 億円			

- まず、「国債の即時グロス決済に関するガイドライン」Ⅳ. 1. (8)に基づき、ペアオフの対象となる取引について、受渡金額の大きいものから順にペア付けを行います。

(ペアオフの対象となる取引)

国債の渡し方となっている取引			国債の受け方となっている取引		
取引	額面	受渡金額	取引	額面	受渡金額
①	50 億円	52 億円	⑩	50 億円	50 億円
②	50 億円	51 億円	⑪	50 億円	49 億円

(イ) ペアオフの対象とならなかった取引に関し、銘柄ごとに、国債の渡し方となっている全ての取引の引渡総額と、国債の受け方となっている全ての取引の受取総額を算出する^(注)。

(注) 引渡総額及び受取総額は、額面金額で算出する。

(ペアオフの対象とならなかった取引)

国債の渡し方となっている取引			国債の受け方となっている取引		
取引	額面	受渡金額	取引	額面	受渡金額
③	30 億円	31 億円	⑫	45 億円	44 億円
④	40 億円	41 億円	⑬	35 億円	34 億円
⑤	5 億円	6 億円	⑭	10 億円	9 億円
⑥	50 億円	49 億円	⑮	10 億円	11 億円
⑦	15 億円	14 億円			
⑧	25 億円	26 億円			
⑨	25 億円	24 億円			

引渡総額 (額面)	190 億円
--------------	--------

受取総額 (額面)	100 億円
--------------	--------

- 国債の渡し方となっている全ての取引の引渡総額（額面）と、国債の受け方となっている全ての取引の受取総額（額面）を算出します。ここでは、引渡総額（額面）が 190 億円、受取総額（額面）が 100 億円です。

(d) (イ)の引渡総額と受取総額のいずれか大きい方を構成する全ての取引を次の手順に従って順位付けする。

- (a) 額面金額をキーとして、額面金額の大きいものから順位付けする。
- (b) 額面金額が同一の取引が複数ある場合には、受渡金額の大きいものから順位付けする。
- (c) 額面金額及び受渡金額が同一の取引が複数ある場合には、約定日付の古いものから順位付けする。
- (d) 額面金額、受渡金額及び約定日付が同一の取引が存在する場合の取扱いは、当事者間で確認することで対応する。

- 受取総額よりも引渡総額の方が大きいため、国債の渡し方となっている全ての取引（取引③～⑨）を、ガイドラインに定める手順に従って、順位付けします。

国債の渡し方となっている取引				国債の受け方となっている取引		
順位	取引	額面	受渡金額	取引	額面	受渡金額
1	⑥	50 億円	49 億円	⑫	45 億円	44 億円
2	④	40 億円	41 億円	⑬	35 億円	34 億円
3	③	30 億円	31 億円	⑭	10 億円	9 億円
4	⑧	25 億円	26 億円	⑮	10 億円	11 億円
5	⑨	25 億円	24 億円			
6	⑦	15 億円	14 億円			
7	⑤	5 億円	6 億円			

引渡総額 (額面)	190 億円
--------------	--------

受取総額 (額面)	100 億円
--------------	--------

(ハ) (ロ)における順位付けの高い取引から、(イ)の引渡総額と受取総額のいずれか小さい方の金額を超えるまで、取引の額面金額を集計する。

- 国債の渡し方となっている取引を、順位付けの高い取引から、受取総額 100 億円を超えるまで、取引の額面金額を集計します。
- ここでは、取引⑥、④及び③（順位 1 から 3 まで）を集計すると、集計した額面金額（120 億円）が受取総額（100 億円）を超えることとなります。

国債の渡し方となっている取引				国債の受け方となっている取引		
順位	取引	額面	受渡金額	取引	額面	受渡金額
1	⑥	50 億円	49 億円	⑫	45 億円	44 億円
2	④	40 億円	41 億円	⑬	35 億円	34 億円
3	③	30 億円	31 億円	⑭	10 億円	9 億円
4	⑧	25 億円	26 億円	⑮	10 億円	11 億円
5	⑨	25 億円	24 億円			
6	⑦	15 億円	14 億円			
7	⑤	5 億円	6 億円			

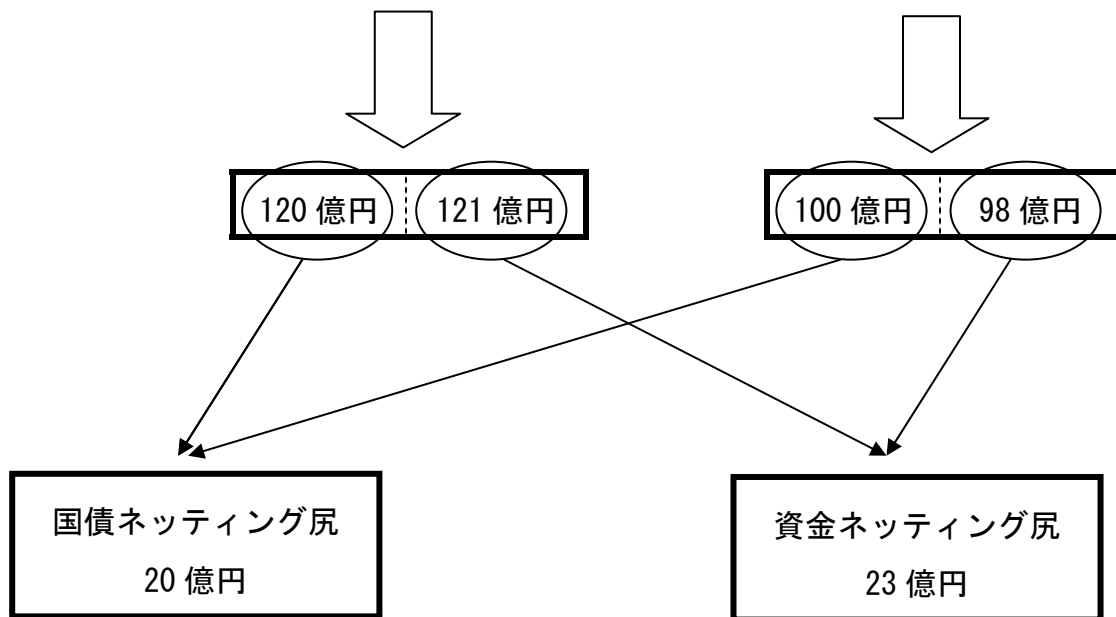
集計した 額面金額	120 億円
--------------	--------

受取総額 (額面)	100 億円
--------------	--------

(ニ) (イ)の引渡総額と受取総額のいずれか小さい方を構成する全ての取引と、(ハ)で額面金額を集計した取引を対象に異額面のペイメント・ネットィングを行う。

- 取引⑥、④、③及び取引⑫～⑮を対象に、異額面のペイメント・ネットィングを行い、ネットィング尻を決済することとなります。

国債の渡し方となっている取引				国債の受け方となっている取引		
順位	取引	額面	受渡金額	取引	額面	受渡金額
1	⑥	50 億円	49 億円	⑫	45 億円	44 億円
2	④	40 億円	41 億円	⑬	35 億円	34 億円
3	③	30 億円	31 億円	⑭	10 億円	9 億円
				⑮	10 億円	11 億円



- ここでは、国債の渡し方となっている取引について、ネットィング尻（国債が 20 億円、資金が 23 億円）の決済を行うこととなります。

(ホ) (ニ)において、異額面のペイメント・ネットティングの対象外とされた取引は、グロス決済とする。

- 異額面のペイメント・ネットティングの対象外とされた取引⑧、⑨、⑦及び⑤は、グロス決済とします。

国債の渡し方となっている取引				国債の受け方となっている取引		
順位	取引	額面	受渡金額	取引	額面	受渡金額
4	⑧	25 億円	26 億円			
5	⑨	25 億円	24 億円			
6	⑦	15 億円	14 億円			
7	⑤	5 億円	6 億円			

以 上

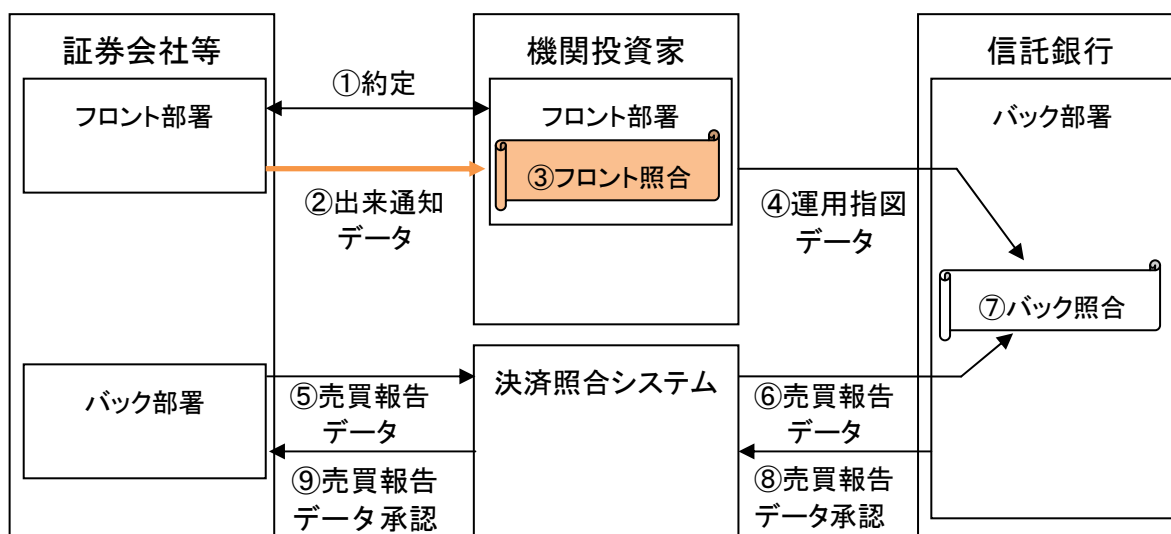
機関投資家や信託銀行と証券会社等との間のフロント照合及び出来通知データの授受等に関する実務取扱指針（案）

1. 総論

(1) 目的

本取扱指針は、平成24年4月にアウトライイトT+2化（国債の売買取引¹にかかる受渡し・決済を原則として売買約定日から起算して3営業日目に行うことをいう。以下同じ。）が実施されることを踏まえ、機関投資家や信託銀行と証券会社等²の間の取引³のフロント照合⁴及び出来通知データの授受等に関する実務の取扱いを定めることを目的とする。具体的には、標準化した出来通知データフォーマット⁵及び出来通知データの電子的な授受の方法に関する実務の取扱いを定めている。

図表 1. 機関投資家や信託銀行と証券会社等との間の取引の流れ



(2) 対象となる取引

¹ 買戻しや売戻の条件を伴わない売買取引。

² 証券会社（金融商品取引法に規定する金融商品取引業者）のほか、短資会社等を想定している。

³ 機関投資家（委託者）が金銭を信託し、信託銀行（受託者）が当該金銭等を信託勘定において管理する取引を典型的な取引として想定している。また、機関投資家ではなく信託銀行自身が、信託勘定で保有する有価証券の運用を行う有価証券運用信託（レポ信託）も含まれる。

⁴ 本取扱指針において、フロント照合とは、機関投資家（レポ信託を行う信託銀行を含む。）のフロント部署において、証券会社等から出来通知データを受領し、約定内容を確認する事務をいう。また、本取扱指針において、バック照合とは、信託銀行のバック部署において、機関投資家から受領した運用指図データと証券会社等から決済照合システムを経由して受領した売買報告データを照合し、売買報告データを承認、確定する事務をいう。

⁵ 機関投資家のフロント部署が証券会社等から受領する出来通知データの様式をいう。

本取扱指針の対象となる取引は、機関投資家や信託銀行と証券会社等との間のレポ取引（条件付売買取引（以下「現先」という。）及び現金担保付貸借取引（以下「現担レポ」という。））である⁶。

また、（株）証券保管振替機構が提供する決済照合システムの利用形態との関係で整理した場合、運用指図サポート対象外型⁷を本取扱指針の対象となる典型的な取引として想定している。これに対し、決済照合システムの機能拡張（平成 26 年の予定）の後に、機関投資家や信託銀行と証券会社等との間のレポ取引について、三者間センタマッチング（運用指図データ配信サービス利用型）を利用する場合には、機関投資家は、出来通知データの電子的な授受を行わずとも決済照合システムを経由して送信されるデータを基に運用指図データを作成するため、以下の 2. 及び 3. に定める取扱いは不要となる。

なお、本取扱指針の対象となるレポ取引以外の取引についても、当事者間の合意により、出来通知データフォーマットの標準化及び出来通知データの電子的な授受を行うことは可能である。このため、参考として、売買取引用の出来通知データフォーマットも作成している。

(3) 出来通知データフォーマットの標準化及び出来通知データの電子的な授受の目的及び要否

(2) で示すとおり、本取扱指針の対象となる取引は、機関投資家や信託銀行と証券会社等との間のレポ取引である。アウトライト T+2 化の実施に伴い、T+1 日に受渡し・決済を行うレポ取引における、ポスト・トレード事務に関する市場共通タイムスケジュールは図表 2. のとおりであり、機関投資家や信託銀行と証券会社等の間では、約定日中にポスト・トレード事務（約定照合、ネットィング）を完了させることが必要となる。

⁶ 非居住者取引は、対象外である。また、決済代行（銀行等が、取引を執行した顧客からの指図に基づき資金・債券の受渡を代理で行う決済形態）については、銀行等と顧客との間で個別に事務フローの見直し等を図ることが適当とされている。

⁷ 機関投資家が運用指図データを自ら作成した上で、決済照合システムを経由せずに信託銀行に同データを送付するタイプの利用形態を指す。

図表 2. 市場共通タイムスケジュール

	改正前	改正後（アウトライト T+2 化実施後）		
		JGBCC 清算取引	非 JGBCC 清算取引	
			ネット決済	グロス決済
約定照合時限		▶決済照合システム 入力時限⇒17:00 ▶照合時限⇒18:30	▶照合時限の目安 ⇒15:30～15:45	▶照合時限⇒18:30
ネットティング 時限	▶照合通知交換時限 ⇒12:00 ▶照合時限⇒15:00 ▶JGBCC 債務引受 ⇒18:30	▶JGBCC 債務引受 ⇒18:30	▶照合通知交換時 限 ⇒16:00 ▶照合時限⇒17:00	

（注）時限は何れも決済日前営業日（S-1）の時刻を示す。

ポスト・トレード事務の迅速化を図るためには、機関投資家から信託銀行への運用指図データ（図表 1. の④）が電子化され日中逐次送信されていることや、証券会社等から信託銀行への売買報告データ（図表 1. の⑤及び⑥）が日中逐次送信されていることが有用である。出来通知データフォーマットの標準化及び出来通知データの電子的な授受が行われれば、機関投資家のフロント部署の運用指図データ（図表 1. の④）の電子化・日中逐次送信が可能となることから、証券会社等のバック部署による決済照合システムを経由した売買報告データ（図表 1. の⑤及び⑥）の日中逐次送信と相俟って、ポスト・トレード事務の迅速化に資することとなる。したがって、レポ取引を活発に行う証券会社等は、機関投資家（レポ信託を行う信託銀行を含む。以下同じ。）との間のレポ取引について、本取扱指針に沿って、出来通知データフォーマットの標準化及び出来通知データの電子的な授受を行うことが期待される。

ただし、図表 2. の市場共通タイムスケジュールに則り、各約定日中にポスト・トレード事務を完了させるため、出来通知データフォーマットの標準化及び出来通知データの電子的な授受が必要か否かは、以下の点などを踏まえて検討し、当事者間で合意した場合には、以下の 2. 及び 3. と異なる取扱いをすることも可能である（出来通知データの送受信の頻度を検討する際には 2. ⑤を参照）。

- ・ 非 JGBCC 清算取引⁸の取引量
- ・ 機関投資家におけるフロント照合の電子化のニーズ
- ・ ポスト・トレード事務の迅速化のニーズ（約定時間の確保、信託銀行におけ

⁸ レポ取引のうち、(株) 日本国債清算機関により債務引受されない取引をいう。

るバック照合の迅速化等)

2. 出来通知データフォーマットの標準化

出来通知データフォーマットの作成及び送信等の取扱いは、以下の①から⑤を標準とする。

①データ項目

○ 出来通知データフォーマットのデータ項目は、別紙1を標準とする。

(データ項目の分類)

- ・ 出来通知データフォーマットのデータ項目は、2分類あり、定義は以下のとおり。
 - 必須項目：証券会社等による入力が必要のデータ項目
 - 任意項目：証券会社等による入力が必要なデータ項目
 - ✓ 入力の有無は、証券会社等が決定できる。ただし、データ項目欄は必要。

(ファンドコードの取扱い)

- ・ ファンドコードは、原則として統一ファンドコードを利用すること。ただし、統一ファンドコードがないファンドの場合には、取引開始前に証券会社等に伝達したファンドコード（口座開設時の下10桁の番号）を利用すること。

②ファイル形式

○ 出来通知データのファイル形式は、Excel形式又はCSV形式を標準とする。

(拡張子等)

- ・ Excel形式は、Excel97からExcel2003に互換性のある形式（拡張子が.xlsであるもの）を標準とする。
- ・ CSV形式では、可変長のカンマ区切りを標準とする。なお、CSV形式は、Webサービスにより出来通知データの授受を行う場合等を想定しており、電子メールによりパスワードを付して出来通知データを送信する場合には、ファイルを圧縮し、圧縮したファイルにパスワードを付さない限りCSV形式は取り得ない。

- 当事者間で合意した場合には、出来通知データのファイルを圧縮することができる。

(圧縮形式)

- ・ 出来通知データのファイルを圧縮する場合には、圧縮形式 (.zip 形式、.lzh 形式等) やパスワードの有無等、当事者間で予め合意しておくこととする。

③ファイル名称

- 出来通知データのファイル名称は、「会社名 (ファイル送信側) + 会社名 (ファイル受信側) + 取引区分 (現担レポ、現先、又は売買) + 約定日 (yyyymmdd) + _ (アンダーバー) + 枝番 (任意)」とする。

- ・ 会社名は、金融機関コード (決済照合システムで使用する BIC コード (支店コード除く)、又は冒頭に金融・証券区分コード (「0」又は「1」) を付した統一金融機関番号又は証券会社等標準コード (計 5 桁)) を用いる。
- ・ 取引区分は、現担レポの場合は「repo」、現先の場合は「gensaki」、売買の場合は「baibai」とする。
- ・ 複数のファイルを送信する場合には、枝番を付すこととする。

(例) DWSCJPJTSTBCJPJTrepo20101122_001.csv

④セキュリティ

- 出来通知データのファイルを電子的に授受する際には、パスワードの設定を標準とし、パスワードの設定ルールは、当事者間で合意した任意の方法とする (以下の例を参照)。なお、当事者間で合意した場合には、暗号化を行うことができる。

(パスワードの設定ルールの例)

- ・ パスワードの設定ルールには、以下の方法が考えられる。
 - 固定パスワード (パスワードの変更を行わない方法)
 - 定期的変更 (1 カ月単位等で定期的に変更する方法)
 - 日々設定変更 (パスワードの一部又は全部を毎日変更する方法)
 - 個別設定 (送信の都度、受信者に電話等で連絡する方法)

⑤出来通知データの送受信の頻度

- | |
|--------------------------------------|
| ○ 出来通知データの送受信は、原則として、日中逐次行うことを標準とする。 |
|--------------------------------------|

(送受信の頻度と後続事務への影響)

- ・ 1. (3) に記載のとおり、証券会社等と機関投資家との間で合意した場合には、出来通知データの送受信(図表 1. の②)を1日1回とするなど異なる取扱いをすることも可能である。ただし、出来通知データの送受信の頻度は、信託銀行におけるバック照合(図表 1. の⑦)の迅速性に影響を与え得る。具体的には、出来通知データの送受信の頻度を1日1回とする場合には、機関投資家による運用指図データの送信(図表 1. の④)、信託銀行によるバック照合(図表 1. の⑦)も1日1回集中して行うこととなる。このため、機関投資家及び証券会社等の間の非 JGBCC 清算取引の取引量などを踏まえて、出来通知データの送受信の頻度について、標準と異なる取扱いを検討する場合には、こうした後続事務への影響を考慮する必要がある。

(留意事項)

- ・ 1 取引は1回のみの送信とし、同じ取引を重複して送信することは行わない。
- ・ 証券会社等は、送信済の出来通知データを訂正しようとする場合は、①証券会社等から機関投資家へ電話等により取消の連絡を行ったうえ、②訂正する出来通知データのみファイルを送信する。
- ・ 出来通知データ(訂正分)の送信は、原則として、1訂正につき1回とする。

3. 出来通知データの電子的な授受の方法

出来通知データの電子的な授受の方法については、事務上の混乱が生じないように、機関投資家や信託銀行と証券会社等の間で予め十分に確認しておくことが推奨される。電子的なデータ授受手段の例としては、以下のものが考えられる。

- ・ Web サービス⁹
- ・ 電子メール

以 上

⁹ Web サービスを利用する際に、当該 Web サービスの提供ベンダーに確認することが望ましい事項については、別紙 2 参照。

◆CSV形式にするのかExcel形式にするのか(統一するのかないのかも含めて)2011年1月以降の分科会で決定する。

【CSV形式】 ※Excel形式の場合には別途定義要。

項番	項目名称	桁数	タイプ	単位	表示方法	セット内容	設定方法 (◎必須、▲任意設定)	サンプル	備考
1	SEQ	4	数字	—	9999	送信ファイル内でのSEQ番号	◎	0001	
2	取引業者	8	英数字	—	xxxxxxxx	取引業者コード(BCコード又は5桁統一金融機関コード(頭「0」、証券会社等標準コード(頭「1」の5桁コード)	◎	1234JPJT	
3	信託銀行ファンドNO	—	英数字	—	x---x	ファンド番号19桁で左詰め 信託銀行との取引になるものは必須	◎	5000000001	
4	受託	—	—	—	—	—	▲		
5	再信託先	—	—	—	—	—	▲		
6	約定日	8	数字	—	yyyymmdd	当該取引の約定日	◎	20091201	
7	スタート日	8	数字	—	yyyymmdd	当該取引のスタート受渡日	◎	20091204	
8	エンド日	8	数字	—	yyyymmdd	当該取引のエンド受渡日	◎	20091207	
9	取引種類	4	英字	—	xxxx	「NRST」固定。(現先スタートの意)	◎	NRST	
10	売買コード	4	英字	—	xxxx	買現先/売現先を識別する区分 "BUYI"(買現先) "SELL"(売現先)	◎	BUYI	
11	銘柄	12	英数字	—	JPxxxxxxxxxx	ISINコード	◎	JP17406919B9	
12	銘柄名称	—	英数カナ漢字	—	k---k	銘柄名称	◎	国庫短期証券69回	
13	額面	—	数字	円	9---9	該当取引の決済額面(正数で表示)	◎	5000000000	頭ゼロ埋めなし
14	現先レート	—	数字	%	999.9999999	当該取引の現先レート	◎	0.11	頭ゼロ埋めなし
15	単価(スタート)	—	数字	円	999.9999999	当該取引のスタート単価(利含み単価)	◎	99.963	頭ゼロ埋めなし
16	精算金額(スタート)	—	数字	円	9---9	当該取引のスタート決済金額	◎	4998150000	頭ゼロ埋めなし
17	経過利子額(スタート)	—	数字	円	9---9	当該取引のスタート経過利息額	◎	0	頭ゼロ埋めなし
18	単価(エンド)	—	数字	円	999.9999999	当該取引のエンド単価(利含み単価)	◎	99.9639038	頭ゼロ埋めなし
19	精算金額(エンド)	—	数字	円	9---9	当該取引のエンド決済金額	◎	4998195190	頭ゼロ埋めなし
20	経過利子額(エンド)	—	数字	円	9---9	当該取引のエンド経過利息額	◎	0	頭ゼロ埋めなし
21	債券形態	—	—	—	—	—	▲		
22	約定時間	4	数字	—	9999	約定時間を照合する場合に設定。指定なしの場合には「0000」を設定。	◎	1000	
23	スタート時限	4	数字	—	9999	決済時限がある場合には時間を設定。指定なしの場合には「即時:0000」を設定。	◎	1300	
24	エンド時限	4	数字	—	9999	決済時限がある場合には時間を設定。指定なしの場合には「即時:0000」を設定。	◎	0000	
25	取引番号	—	英数字	—	x---x	取引を特定する番号(送信者側の任意コード)	◎	A161740010	不一致等での照会用
26	メッセージ欄	—	英数字カナ	—	x---x	メッセージ記入欄	▲	ツイヤクジョウブン	

約定照合データ(項目定義書)・・・レポ(GC・SC共通)

◆CSV形式にするのかExcel形式にするのか(統一するのかもしれないのかも含めて)2011年1月以降の分科会で決定する。

【CSV形式】

※Excel形式の場合には別途定義要。

項番	項目名称	桁数	タイプ	単位	表示方法	セット内容	設定方法 (◎必須、▲任意設定)	サンプル	備考
1	SEQ	4	数字	—	9999	送信ファイル内でのSEQ番号	◎	0001	
2	取引業者	8	英数字	—	xxxxxxxx	取引業者コード(BCコード又は5桁統一金融機関コード(頭「0」)、証券会社等標準コード(頭「1」の5桁コード)	◎	1234JPJT	
3	信託銀行ファンドNO	—	英数字	—	x---x	ファンド番号19桁で左詰め 信託銀行との取引になるものは必須	◎	5000000001	
4	受託	—	—	—	—	—	▲		
5	再信託先	—	—	—	—	—	▲		
6	約定日	8	数字	—	yyyymmdd	当該取引の約定日	◎	20091201	
7	スタート日	8	数字	—	yyyymmdd	当該取引のスタート受渡日	◎	20091203	
8	エンド日	8	数字	—	yyyymmdd	当該取引のエンド受渡日	◎	20091204	
9	取引種類	4	英字	—	xxxx	「RPST」固定。(レポスタートの意)	◎	RPST	
10	売買コード	4	英字	—	xxxx	レポ/リバースレポを識別する区分 "BUYI"(リバースレポ)、"SELL"(レポ)	◎	BUYI	
11	銘柄	12	英数字	—	JPxxxxxxxxxx	ISINコード	◎	JP17406919B9	
12	銘柄名称	—	英数字カナ漢字	—	k---k	銘柄名称	◎	国庫短期証券69回	
13	額面	—	数字	円	9---9	該当取引の決済額面(正数で表示)	◎	8500000000	頭ゼロ埋めなし
14	利含み時価	—	数字	円	999.999	当該取引の利含み時価	▲	99.963	頭ゼロ埋めなし
15	基準価格	—	数字	円	9---9	当該取引のスタート約定金額	◎	8855829788	頭ゼロ埋めなし
16	経過利息	—	数字	円	9---9	当該取引のスタート経過利息額	◎	0	頭ゼロ埋めなし
17	基準担保金率	—	数字	%	999.9999999	当該取引に適用する基準担保金率	◎	100	頭ゼロ埋めなし
18	担保金額	—	数字	円	9---9	当該取引のスタート決済金額	◎	8855829788	頭ゼロ埋めなし
19	担保金利率	—	数字	%	999.9999999	当該取引に適用する担保金利率	◎	0.16	頭ゼロ埋めなし
20	金利	—	数字	円	9---9	当該取引の付与金利額	◎	38820	頭ゼロ埋めなし
21	貸借料率	—	数字	%	999.9999999	当該取引の貸借料率	◎	0.01	頭ゼロ埋めなし
22	貸借料	—	数字	円	9---9	当該取引の貸借料額	◎	2426	頭ゼロ埋めなし
23	担保区分	1	数字	—	9	"0"(無担) "1"(有担保/現金担保) "2"(有担保/証券担保)	◎	1	
24	債券形態	—	—	—	—	—	▲		
25	約定時間	4	数字	—	9999	約定時間を照合する場合に設定。指定なしの場合には「0000」を設定。	◎	1000	
26	スタート時限	4	数字	—	9999	決済時限がある場合には時間を設定。指定なしの場合には「即時.0000」を設定。	◎	1300	
27	エンド時限	4	数字	—	9999	決済時限がある場合には時間を設定。指定なしの場合には「即時.0000」を設定。	◎	0000	
28	取引番号	—	英数字	—	x---x	取引を特定する番号(送信者側の任意コード)	◎	A161740010	不一致等での照会用
29	メッセージ欄	—	英数字カナ	—	x---x	メッセージ記入欄	▲	ツイヤクジョウブン	

Webサービス利用に係る提供ベンダーへの確認事項

《利用の前提等》

- Webサービス提供にあつては、一般に利用者全体で①最低利用者数（利用ID数）の確保、②利用データ容量（〇〇ギガバイト）上限が求められる。
- 今回のWebサービスでは、利用者側に運営主体が存在せず、上記①、②を各利用者がコミットすることもできないことから、提供事業者による事業提供の判断材料を提供する必要がある。（提供事業者の事業判断でWebサービスが提供されること）
- 利用者は個別にWebサービス提供事業者へ申し込むこととなるが、利用方法（出来通知データ授受、照合通知データ授受）がパターン化されており、効率的に利用の判断が出来る様、共通的なサービス内容確認項目の整理を行うもの。

《確認項目》（◎は必須項目、○は標準サービスが望ましい項目、●は確認項目）

確認項目	確認内容	A社	B社
(1) WebのID運営管理	<ul style="list-style-type: none"> ● WebのID等の管理（各社、各社代表者）はどのように行われるか（運営者自体が行うか、ユーザーで社内の権限管理か）。 ● ユーザーの利便面では、運営者がID付与、各IDの権限管理を行うほうが望ましい（異動等の場合の変更負荷が軽い）。 ● ファイル、フォルダの参照権限はだれが管理設定するか（新規、変更等）。 ● 相手先利用者の変更等を機動的に行なう上では、ユーザーにもファイル、フォルダの参照権限が付与されることが望ましい。（管理規定は必要） 	<ul style="list-style-type: none"> ● ユーザIDとして個人のメールアドレスを利用。ユーザIDの登録・変更・削除は、弊社管理者が実施。ユーザID登録時に、初期パスワードをユーザへ送信。ユーザが初期パスワードを使用してログインし、その後各自のパスワードに変更。パスワードはユーザが管理。 ✓ フォルダの参照権限は、フォルダ作成者（通常、弊社管理者またはフォルダの編集者）が設定。ファイルの参照権限は、フォルダの参照権限が引き継がれるが、ファイル毎にファイルの編集者が設定することも可能。 	<ul style="list-style-type: none"> ● 弊社がIDを払い出し（申込は10ID単位、未使用IDは追加申し込みで弊社が設定） ● セルサイド（出来通知データの出し手）1社毎にフォルダ（電子会議室）権限設定可能な階層を払い出し。 ● トップ階層権限を有する会社のユーザーがフォルダ（会議室）新設の際に、関係する参照権限を付与。
(2) 情報セキュリティの確保	<p>◎情報のセキュリティ確保は担保されていること。（暗号化技術、外部機関の認証（SAS70等）等）</p> <p>○たとえば国内における金融機関のシステム安全基準等に適合しているか（FISC等）。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● データ送信は、使用可能な商用暗号化水準での最高レベルのひとつ、最大128ビットに暗号化。データセンタ内では、データは暗号化され保管。厳格な第三者による検査および頻繁な監査で、すべての情報の安全な保管・転送を保証。データセンタは、アメリカの会計監査基準であり、統制の機能と遵守を明示するSAS70タイプII認証を取得。 	<ul style="list-style-type: none"> ● 不正操作監視（弊社側関係者の「持ち込み、持ち出しファイル、ログイン履歴、操作履歴」等の証跡監査及び保管を行っている） ● ネットワーク制御—ファイヤーウォールを用いて不正なアクセスを遮断 ● 盗聴対策—ユーザー・サーバー間はSSL対応 ● 監視保守は24時間、365日有人監視、障害にリアルタイム対応 ● 外部認証機関（ISMS（ISO27001）、BCMS 認証 BS25999-2:2007）
(3) 運営サポート体制	<p>◎当初、利用開始時の画面設定、参照権限設定等のサポートは適切に行われるか。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● カスタマーサービスによるサポート方法（オンサイト、電話、メールその他） <p>◎照会（ID付与者）に対するカスタマーサポートは適切に行われるか。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● ID、セキュリティ、オペレーション、エラー対応等が直接、サポートされるか。 	<ul style="list-style-type: none"> ● 弊社カスタマーサポートデスクがオンサイト、電話・メールによりサポート。 ● 各種問合せ対応、およびその後のフォローアップ対応。 <ul style="list-style-type: none"> ・パスワードがわからなくなった ・ユーザがロックされた ・初期交付したパスワードが期限切れになった ・オペレーション方法がわからない ・バウンスバック：送信したメールがアドレス不正で戻ってきた場合の調査および必要に応じたアドレス修正 ・クローズマッチ（企業情報マッチングとユーザ名寄せ） ・似た会社名、アドレスなどで複数ユーザが登録されている場合などの確認 	<ul style="list-style-type: none"> ● 利用開始時の画面設定、参照権限設定は弊社で実施。 ● 照会は、標準的にはエンドユーザーの直接窓口なし。 ● 各社代表者1名からのサービス窓口（メール）対応 平日 9:30～18:00

<p>(4) 運営サポート (続き)</p>	<p>◎照会対応時間帯、日本語対応の時間帯 (*)、時間外の緊急対応の場合に日本語対応可能か。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●営業時間帯 (朝9時から18時ころ) をカバーしていること。 ●本邦金融機関の営業日 (年末:12月30日まで、年始:1月4日から)、営業時間帯 (朝9時から18時ころ) をカバーしていること。 <p>○海外を含む複数オフィス・拠点の利用可能なことが望ましい。その場合のサポート時間帯とサポート言語 (日本語、英語) は可能か。(マスト事項ではないが)</p> <ul style="list-style-type: none"> ●ユーザーマニュアルも英語、日本語が利用可能なことが望ましい。 	<ul style="list-style-type: none"> ●日本時間 9:00~21:00 (土日祝日および年末年始を除く) 12/30、1/4の年末年始サポートも対応可能。 <p>現時点では日本のカスタマーサポートデスク以外の利用不可であるが、今後、サービスレベル拡大の予定あり。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ●日本語対応のみ。 <p>照会対応は弊社営業日 (平日の場合12月28日まで、1月4日から) の対応</p> <p>メール回答の場合、1次回答は2~3時間以内を想定。電話対応、開局時間見直しは、ユーザー規模数を踏まえ検討。</p> <p>画面表示は英語対応。</p>
<p>(5) 提供機能</p>	<p>○データ送信先(相手)がダウンロードやファイル開封した場合の通知機能はあるか。(送信者が画面で確認できるか)</p> <ul style="list-style-type: none"> ●マスト事項ではないが、標準サービスが望ましい。 <p>○フォルダーへのファイルアップロード機能が提供可能か。(オプション利用の場合の追加利用料等)</p>	<p>通知機能はなし。</p> <p>送信者がWebサービスにアクセスし、データ送信先の閲覧状況を確認可。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ●当該画面を表示したかは確認可能。添付ファイルの開封、ダウンロードの確認機能はなし。
<p>(6) 障害対応</p>	<p>◎サーバーダウン、回線障害等、障害発生時のサポートや代替策は用意されているか。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●リカバリーに要する時間はどの程度必要と想定しているか(同一センター内での障害発生の場合、拠点切り替えの場合等、実務影響確認のため) ●過去の障害発生事例はあるか。 ●可用性(例えば99.5%以上)の保証外として想定される事象(0.5%) はどのような事象か。 	<ul style="list-style-type: none"> ●データセンタ全体でのリアルタイム・レプリケーションにより、データの完全性と信頼性を保証。 <p>先進の保管技術、包括的なバックアップ戦略とデータ回復ソリューションにより、緊急事態でも処理の継続が確実に、99.5%の可用性を保証。</p> <p>洗練されたファイアウォール、ウイルススキャン・検出ソフトウェアを導入し、経験豊富なセキュリティ専門家、エンジニア、品質保証スペシャリストによる24時間365日のシステム監視を実施。</p> <p>冗長ネットワーク、予備電源、最新鋭の監視システムの他、「ベストプラクティス」の業務対策により、予期せぬ事象に対して防御。</p>	<ul style="list-style-type: none"> ●サーバ、回線すべて冗長化されており、サービス全体でシングルポインタはなし。 ●ディザスターリカバリーはなし (データセンターは1か所) ●データバックアップは日次実施、ハード障害時もデータ復旧可能 ●過去 (2010年4月のサービス開始以来)、障害発生はなし。
<p>(7) 利用コスト試算</p>	<p>◎利用者を募る上で、利用コストの明示が必要なため、コストシュミレーションの前提の提示が必要。(以下は前提例)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・証券会社30社、機関投資家20社、信託銀行5行が各々10ID利用 (最低150程度の利用を想定) ・証券会社1社のファイル送信20回/日、機関投資家のファイル送信40回/日、 ・ネットィング照合は、各社1回/日 ・その他、算定に必要な条件 (データ保存期間等) <ul style="list-style-type: none"> ●利用コスト (課金体系) はどのように設定されるか (固定、従量制等)。(課金体系を考えるポイント) ●Webサービスの利用者全体で、利用データ容量上限管理できないため、利用者の公平性を確保する上で、ID当たりの利用データ容量上限 (例えば10MB) 設定が望ましい。 <p>◎利用が暫定対応の位置づけであることから利用コストは安価なことが必要。(1利用ID1万円/年間程度)</p>	<ul style="list-style-type: none"> ●社内調整中 	<ul style="list-style-type: none"> ●社内調整中。 <ul style="list-style-type: none"> ●1CSVファイルあたり数キロバイト、1IDあたり10MBの想定。 ●月額ID単位の従量制課金を想定、申し込みは10ID単位。

(8) その他	◎事業者がサービス内容の変更（料金変更等）や、停止する場合、事前通知期間（停止の場合は1年前等）が確保されていること。		
---------	-------------------------------------------------------------	--	--

以上

平成 23 年 3 月 18 日

アウトライイト T + 2 化の実施日について

- アウトライイト T + 2 化の実施日については、昨年 12 月に公表された中間報告書において「期末や期初を回避した 2012 年 4 月中旬ないし下旬を目途」とされている。
- また、アウトライイト T + 2 化に伴い、主として機関投資家（信託銀行）と証券会社等間での取引に関するポストトレード事務の効率化が図られることとなるが、そのためのシステム面の準備を土日に行うことを踏まえると、実施日は、月曜日であることが適当である。
- したがって、具体的な実施日の候補を挙げると、以下の 2 日が考えられる。
 - 2012 年 4 月 16 日（月）
 - 2012 年 4 月 23 日（月）
- 両日のうちいずれが適当かを考えると、4 月 16 日（月）を実施日とした場合には、システム面の準備作業を含むアウトライイト T + 2 化の実施対応準備が決算関係作業と重なるため、作業繰り上厳しいとの声も聞こえている。
- 他方で、4 月 23 日実施とした場合には、4 月 25 日を決済日とする国債取引が増加することとなる。この点、3 月、6 月、9 月、12 月と比べて 4 月 25 日近傍で国債決済が特に多くなる訳ではないことを踏まえると、4 月 23 日を実施日とすることについて特段の問題はないと考えられる（別紙参照）。
- したがって、4 月 23 日を実施日案として、証券受渡・決済制度改革懇談会（以下「懇談会」という。）及び証券決済制度改革推進会議（以下「推進会議」という。）に提案したいと考えている。
- 今後、アウトライイト T + 2 化の準備状況については、当 WG でも事務局を中心に定期的に確認していくこととする。なお、2012 年 4 月 23 日を実施日とすることが適当でないとする特段の事情が発生した場合には、懇談会及び推進会議において、実施日の変更を提案することも考えられる。

以 上

DVP決済件数の推移

