

2017年11月（改定版）

総合運転試験（RT）に関する「実施手順書」 ＜フェーズ2編＞

記載内容は、今後の検討次第で変更となる可能性があります。

目次<フェーズ2編>

1. テスト概要	2
2. テスト参加対象先	4
3. RTの実施環境.....	4
(1) 市場インフラのテスト環境（システム面、業務面）	4
(2) 運行スケジュール	4
4. 一日の流れ（テスト内容）	5
5. 留意事項	6

1. テスト概要

- フェーズ2では、日銀ネットと連動した決済関連の新規・変更機能の確認を行うこととし、テストの概要は次表のとおりです。

(*)参加者分類は参加者の取扱対象取引に応じて以下の二つに分類します。

- ① 売買・先決めレポ取引のみの清算を行う清算参加者
- ② 後決めレポ取引の清算を行う清算参加者

(凡例) ○：必須テスト △：任意テスト ー：不可 □：確認時期

項番	区分	シナリオ	参加者分類 (*)		確認可能 タイミング	
			①	②	RT2-1	RT2-2
1	後決めレポ (※1)	a. 後決めレポの約定・決済（2回目引受）の確認（※2）	ー	○	□	□
		b. 後決めレポの約定・決済（3回目引受）の確認（※2）	ー	○	□	□
		c. 後決めレポの約定・決済（翌日1回目引受）の確認（※2）	ー	○	□	□
		d. Unwind/Rewindの確認	ー	○	ー	□
		e. フェイル決済の確認（※2）	ー	○	ー	□
2	FOS 決済	a. 1回目のFOS決済予定通知の確認	○	○	□	□
		b. 1回目のFOS決済の確認	○	○	□	□
		c. 2回目のFOS決済予定通知（後決め分）の確認	ー	○	□	□
		d. 2回目のFOS決済（後決め分）の確認	ー	○	□	□
3	当初証拠金決済	a. 1日3回の当初証拠金通知の確認	○	○	□	□
		b. 当初証拠金の差入・返戻の確認	○	○	□	□

項番	区分	シナリオ	参加者分類 (*)		確認可能 タイミング	
			①	②	RT2-1	RT2-2
4	清算基金決済	a. 清算基金通知の確認	○	○	□	□
		b. 清算基金の差入・返戻の確認	○	○	□	□
5	終了通知	a. 1日5回の終了通知の確認	○	○	□	□
6	繰越機能等	a. 繰越、超過割当、フェイルと続く一連の確認	—	△	□	□

(※1) テスト参加者間で取引実績のあるテスト相手先、今後取引相手となりうるテスト相手先と個別にテストシナリオをご調整のうえテストを実施してください。テスト参加者においてシステム障害等が発生した場合、予定していたテストが実施出来なくなる恐れがあるため、2017年4月に実施の事前調査の結果をもとに作成されるテスト参加者連絡先及び、RT連絡会を活用いただき、複数先にテスト相手を依頼してください。なお、テスト相手先との調整状況につきましては、今後、適宜アンケートを実施させていただき、フォローさせていただきます。

(※2) JSCCからの通知電文の確認を含みます。

2. テスト参加対象先

- ・ JSCCの国債店頭取引清算資格を取得している市場参加者について、テスト参加を**必須**とします。
※アウトライト T+1 等、後決めレポ取引以外の変更も予定されていることから、国債店頭取引に係る全清算参加者が対象となります。
なお、T+1 化実施時より JSCC の利用を開始する清算参加者につきましてもフェーズ2にご参加ください。
また、三者間センタマッチング型のテストを実施する場合は、運用指図データを送信する運用会社へのテスト参加依頼を個別にご調整ください。

3. RT の実施環境

(1) 市場インフラのテスト環境（システム面、業務面）

- ・ 「総合運転試験（RT）に関する「実施手順書」＜共通編＞」をご参照ください。
また、T+1 化実施時に利用する接続方式でテストを実施してください。

(2) 運行スケジュール

- ・ タイムスケジュールはフェーズ3と異なりますのでご注意ください。
詳細につきましては、「別紙3-1 タイムスケジュール（フェーズ2）」をご参照ください。

4. 一日の流れ（テスト内容）

- ・ 一日の流れについては、「別紙3-1 タイムスケジュール（フェーズ2）」をご参照ください。
- ・ テスト内容については、「別紙3-2 テストケース（フェーズ2）」を参考に、テストシナリオを検討いただき、テストを実施してください。なお、別紙3-2の項番及びシナリオにつきましては、「1. テスト概要」と対応づけされています。
- ・ 日銀ネットのコアタイムについては、テスト参加者毎に必要なテスト内容が大きく異なるため、特別設定いたしません。テスト参加者にて予定されたテストを完了した場合は、17:00の市場インフラ稼働終了時刻を待たず、テストを終了することが可能です（この際、テスト終了可否に係る電話連絡等は不要です）。

5. 留意事項

- ・ 「1. テスト概要」に記載の必須テスト以外の確認を実施する場合は、任意で実施してください。
- ・ 稼働時に想定される取引量を大幅に超える件数の売買報告データ（国債／通常（売買））、売買報告データ（国債／レポ・現先）、売買報告データ（国債／現先（銘柄後決め方式））、割当可能残高通知データを送信しないでください。
- ・ RT2-1 における 1 回目の FOS 決済予定、清算基金決済予定は、2017 年 10 月頃に予め提示いたしますので、それを基に確認してください。
- ・ 当初証拠金決済及び清算基金決済に係る代用有価証券の差入・返戻の確認については、先に差入を実施した後、残高の範囲内で返戻を実施してください。
- ・ RT2-1 において売買報告データ（国債／通常（売買））、売買報告データ（国債／レポ・現先）を送信することで売買・先決めレポの T+1 約定及び、RT2-2 で DVP 決済の確認が可能です。任意で実施してください。
- ・ 翌営業日が利払日の銘柄における後決めレポ銘柄割当結果確認については、RT2-2 において後決めレポの債務引受時限 1 回目の割当が可能であること、債務引受時限 2・3 回目の割当は不可であることの確認が可能ですので、任意で実施してください。
- ・ 後決めレポの Unwind/Rewind で銘柄入替を行う予定がある場合は、エンド日を 2017 年 9 月 20 日以降としてください。
- ・ 物価連動国債の手数料選択申請を行った清算参加者は、任意で各社で想定している物価連動国債を用いた機能（確認可能な機能の範囲は、物価連動国債に係る約定～決済（売買・先決めレポ、後決めレポ）及び、当初証拠金・清算基金における代用有価証券としての差入・返戻です）の確認を実施してください。
- ・ RT2-1、RT2-2 では国債バスケット(分離元本・分離利息)を繰越確認専用のバスケットとして使用します。割当可能残高通知データへ分離元本振替国庫債券、分離利息振替国庫債券を含めないでください。

以 上

【タイムスケジュール(フェーズ2)】

2回目11:00(±0)、3回目13:00(-1h)、フェイル通知14:30(-2.5h)、夜間バッチ(15:00(-3.5h))

実時刻 (日銀ネット想定時刻) ※1		9:00 (9:00)	10:00 (10:00)	11:00 (11:00)	12:00 (12:30)	13:00 (14:00)	14:00 (15:30)	15:00 (18:30)	16:00 (19:45)	17:00 (21:00)	備考						
		事前準備									システム立上げ時						
日銀	日銀ネット	JSCC接続時間帯									JSCC接続時間(国債/当預)						
ほふり	決済照会システム	JSCC接続時間帯									JSCC接続時間						
JSCC	参加者端末	端末接続時間帯									参加者端末接続時間						
	1.後決めレボ取引	割当可能残高通知									2回目割当分	3回目割当分	1回目割当分(翌営業日)	割当可能残高通知を受信した都度、割当可能残高通知データ受付通知データを送信。			
		債務認定・バスケットネット									2回目割当分	3回目割当分	1回目割当分(翌営業日)	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))を受信した都度、債務認定結果通知データ(バスケット)を送信。			
		債務引受 銘柄割当・銘柄ネット									1回目	2回目	3回目	債務引受時限にて引受確定、債務引受一覧通知データ(バスケット)通知、ネット結果通知データ(バスケット)通知、銘柄割当通知データ通知、ネット結果通知データ(個別銘柄)通知、ネット結果通知データ(個別銘柄)通知。			
	DVP決済	DVP決済予定算出									1回目	2回目	3回目	DVP決済予定通知データ(後決め)通知。			
		DVP決済(受取)									1回目DVP決済(受取)	2回目DVP決済(受取)	3回目DVP決済(受取)	DVP決済予定通知データ(後決め)通知完了後、速やかに国債資金同時受取依頼(指示なし)を送信。			
		DVP決済(引渡)									1回目DVP決済(引渡)	2回目DVP決済(引渡)	3回目DVP決済(引渡)	DVP決済予定通知データ(後決め)通知完了後、速やかに国債資金同時受取依頼(指示なし)を送信。			
		フェイル通知									フェイル通知		ネット結果通知データ(個別銘柄)(フェイル)通知、DVP決済予定通知データ(後決め)(フェイル)通知。				
共通	2.FOS決済	FOS決済予定算出									FOS決済予定算出		FOS決済予定通知データ通知。				
		FOS決済(受取/支払)									受取	支払		参加者はFOS決済予定通知データを確認しFOS決済を行う。			
		FOS決済(後決め)算出									FOS決済予定算出		FOS決済予定通知データ(後決め)通知。				
		FOS決済(後決め)(受取/支払)									受取	支払		参加者はFOS決済予定通知データ(後決め)を確認しFOS決済を行う。			
	3.当初証拠金決済	当初証拠金所要額算出									1回目分	2回目分	3回目分	当初証拠金通知データ(1回目、2回目、3回目)通知。			
		差入									1回目差入	2回目差入	3回目差入	当初証拠金通知データ(1回目、2回目、3回目)を確認し必要に応じて差入を行う。			
		返戻									1回目返戻依頼	1回目返戻	2回目返戻依頼	2回目返戻	3回目返戻依頼	3回目返戻	当初証拠金算出後から参加者端末より返戻依頼可能。参加者は当初証拠金通知データ(1回目、2回目、3回目)を確認し必要に応じて返戻依頼を行い、返戻の確認を行う。
	4.清算基金決済	清算基金									清算基金所要額算出		清算基金通知データ通知。				
		差入									差入			参加者は清算基金通知データを確認し必要に応じて差入を行う。			
		返戻									返戻依頼	返戻		参加者は清算基金通知データを確認し必要に応じて返戻依頼を行い、返戻の確認を行う。			
	5.終了通知	1回目									2回目	3回目	4回目	5回目			

※1:括弧内の下線付き想定時刻は実時刻と乖離することを表します。
 ※2:破線部分については、RT2-2のみ実施します。

別紙3-2

テストケース(フェーズ2)

株式会社日本証券クリアリング機構

■テストケースの見方

- ・当テストケースは、証券保管振替機構における決済照合システムの「二者間センタマッチング型」を利用する清算参加者の例を記載しております。「プロパー型」、「運用指図サポート対象外型」及び「三者間センタマッチング型」を利用する清算参加者におかれましては、売買報告データ(国債／現先(銘柄後決め方式))送信に関して、各型の業務フローに応じて読み替えてください。
- ・当テストケースはテスト参加者とほふりとの接続はJEXGW接続方式をイメージした例を記載しています。ほふりとの接続が統合Web端末のみ利用してのテスト参加者におきましては、JSCCからの電文確認はJSCCの参加者端末より該当電文の情報をダウンロードし実施ください。
- ・資金運用のみを行うことを想定している参加者につきましては、渡方となるテストケースは対象外とすることも可です。

■テストケースと本編の「総合運転試験(RT)に関する「実施手順書」<フェーズ2編>1. テスト概要」との対応付け

1

【項番1 後決めレポ】

2

3

<テストケース a-1 後決めレポの約定・決済の確認(通常ケース:2回目引受)>

1			4				
渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考

1

【項番2 FOS決済】

2

4

2	4				
テストケース	項目	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考

①項番

本編の「1. テスト概要」における表の項番と対応付けしております。

②テストケースの英小文字

本編の「1. テスト概要」の表の各項番におけるテストケースと対応付けしております。

③項番1におけるテストケースの「-1」及び「-2」

テストケースの英小文字が同一のテストケース(例:a-1とa-2)につきましては、渡方・受方が反対となっているのみで、その他の記載は全て同様です。

④確認可能時間帯(実時刻)

テスト実施時に確認が可能な大凡の実時刻を記載しております。「別紙3-1_タイムスケジュール(フェーズ2)」記載されている日銀ネット想定時刻とあわせてご確認ください。

【項番1 後決めレポ】

<テストケース a-1 後決めレポの約定・決済の確認(通常ケース:2回目引受)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
参加者A	参加者B	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり		9:00~11:00	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方				
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方				
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方				
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				
		国債資金同時受渡依頼受付案内(EX7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	RT2-1、 RT2-2	11:00~11:30	
		DVP1	渡方				
		決済指示(国債)(INQ751201)送信					
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信					
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信					
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信	渡方				
		DVP2	受方				
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信					
決済指示(資金)(INQ751301)送信							
国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信							
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信	受方						
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信	受方						

<テストケース a-2 後決めレポの約定・決済の確認(通常ケース:2回目引受)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
参加者B	参加者A	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり		9:00~11:00	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方				
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方				
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方				
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	RT2-1、 RT2-2	11:00~11:30	
		DVP1	渡方				
		決済指示(国債)(INQ751201)送信					
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信					
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信					
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信	渡方				
		DVP2	受方				
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信					
決済指示(資金)(INQ751301)送信							
国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信							
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信	受方						
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信	受方						

<テストケース b-1 後決めレポの約定・決済の確認(通常ケース:3回目引受)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
参加者A	参加者B	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-1、 RT2-2	11:00~13:00	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方				
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方				
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方	13:00~13:30			
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	13:00(※3)~ 14:00			
		DVP1	渡方				
		決済指示(国債)(INQ751201)送信					
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信					
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信					
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信	渡方	13:00(※3)~ 14:30			
		DVP2	受方				
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信					
決済指示(資金)(INQ751301)送信							
国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信							
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信							
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信							

<テストケース b-2 後決めレポの約定・決済の確認(通常ケース:3回目引受)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
参加者B	参加者A	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-1、 RT2-2	11:00~13:00	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方				
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方				
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方	13:00~13:30			
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	13:00(※3)~ 14:00			
		DVP1	渡方				
		決済指示(国債)(INQ751201)送信					
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信					
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信					
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信	渡方	13:00(※3)~ 14:30			
		DVP2	受方				
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信					
決済指示(資金)(INQ751301)送信							
国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信							
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信							
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信							

<テストケース c-1 後決めレポの約定・決済の確認(通常ケース:翌日1回目引受)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
参加者A	参加者B	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-1	13:00~17:00	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方				
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方				
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方				
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	RT2-2	9:00~9:30	
		DVP1	渡方			9:00(※3)~ 10:30	
		決済指示(国債)(INQ751201)送信					
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信					
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信					
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信	渡方				
		DVP2	受方	9:00(※3)~ 11:00			
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信					
決済指示(資金)(INQ751301)送信							
国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信							
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信	受方						
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信	受方						

<テストケース c-2 後決めレポの約定・決済の確認(通常ケース:翌日1回目引受)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
参加者B	参加者A	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-1	13:00~17:00	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方				
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方				
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方				
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	RT2-2	9:00~9:30	
		DVP1	渡方			9:00(※3)~ 10:30	
		決済指示(国債)(INQ751201)送信					
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信					
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信					
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信	渡方				
		DVP2	受方	9:00(※3)~ 11:00			
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信					
決済指示(資金)(INQ751301)送信							
国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信							
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信	受方						
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信	受方						

<テストケース d-1 後決めレポの約定・決済の確認(Unwind/Rewindの確認)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考	
参加者A	参加者B	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-1	11:00~13:00	エンド日は9/20以降を設定してください	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				エンド日は9/20以降を設定してください	
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方					
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方					
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方					
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				13:00~13:30	
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	渡方	日銀	RT2-1	13:00(※3)~ 14:00	
		DVP1						
		決済指示(国債)(INQ751201)送信						
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信						
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信						
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信						
		DVP2	受方	13:00(※3)~ 14:30				
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信						
		決済指示(資金)(INQ751301)送信						
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信						
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信						
		国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信						
割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-2	9:00~9:30	13:00~17:00			
割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方・受方							
債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				9:00~17:00			
Unwind・Rewind 情報を参加者端末よりダウンロード	渡方・受方	JSCCの 参加者端						

<テストケース d-2 後決めレポの約定・決済の確認(Unwind/Rewindの確認)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考	
参加者B	参加者A	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-1	11:00~13:00	エンド日は9/20以降を設定してください	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				エンド日は9/20以降を設定してください	
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方					
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方					
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方					
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				13:00~13:30	
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	渡方	日銀	RT2-1	13:00(※3)~ 14:00	
		DVP1						
		決済指示(国債)(INQ751201)送信						
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信						
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信						
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信						
		DVP2	受方	13:00(※3)~ 14:30				
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信						
		決済指示(資金)(INQ751301)送信						
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信						
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信								
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信								
割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-2	9:00~9:30	13:00~17:00			
割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方							
債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方							
Unwind・Rewind 情報を参加者端末よりダウンロード	渡方・受方	JSCCの 参加者端		9:00~17:00				

<テストケース e-1 後決めレポの約定・決済の確認(フェイル発生ケース)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
参加者A	参加者B	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-1	9:00~11:00	
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方				
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方				
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方				
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	RT2-1	11:00(※3)~ 13:00	フェイルを確認するため、RT2-1では一部のDVP決済を実施しないでください
		DVP1(未実施)	渡方				
		DVP2(未実施)	受方				
		フェイル確認書を参加者端末よりダウンロード	渡方・受方	JSCCの 参加者端		13:00~17:00	
		ネットティング結果通知データ(フェイル)(個別銘柄)(02-0239150x-39100)、DVP決済予定通知データ(フェイル)(後決め)(02-0239170x-39100)受信(※2)	渡方・受方	ほふり		14:30~15:00	
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	RT2-2	9:00(※3)~ 10:30	RT2-2において、DVP決済予定通知データ(フェイル)(後決め)に基づきDVP決済を実施してください
		DVP1(フェイル分)	渡方				
		決済指示(国債)(INQ751201)送信					
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信					
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信					
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信					
		DVP2(フェイル分)	受方			9:00(※3)~ 11:00	
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信					
		決済指示(資金)(INQ751301)送信					
国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信							
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信							
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信							

<テストケース e-2 後決めレポの約定・決済の確認(フェイル発生ケース)>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
参加者B	参加者A	売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	渡方	ほふり	RT2-1	9:00~11:00	フェイルを確認するため、RT2-1では一部のDVP決済を実施しないでください
		売買報告データ(国債/現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信(※)	受方				
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方				
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信(※)	渡方				
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)	渡方				
		債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方	日銀		11:00~11:30	
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方				
		DVP1(未実施)	渡方				
		DVP2(未実施)	受方	JSCCの 参加者端		13:00~17:00	
		フェイル確認書を参加者端末よりダウンロード	渡方・受方				
		ネットティング結果通知データ(フェイル)(個別銘柄)(02-0239150x-39100)、DVP決済予定通知データ(フェイル)(後決め)(02-0239170x-39100)受信(※2)	渡方・受方	ほふり	14:30~15:00		
		国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	RT2-2	9:00(※3)~ 10:30	RT2-2において、DVP決済予定通知データ(フェイル)(後決め)に基づきDVP決済を実施してください
		DVP1(フェイル分)	渡方				
		決済指示(国債)(INQ751201)送信					
		国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7512-00100)受信					
		国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00200)受信					
		当座勘定入金通知(国債資金同時受渡)(EX2111-01800)受信					
		DVP2(フェイル分)	受方		9:00(※3)~ 11:00		
		国債資金同時受渡決済指示対象通知(EX7511-00300)受信					
		決済指示(資金)(INQ751301)送信					
国債資金同時受渡決済指示受付通知(RES7513-00100)受信							
国債資金同時受渡実行通知(EX7512-00300)受信							
国債資金同時受渡実行通知(資金)(EX7512-00400)受信							

※物価連動国債の手数料選択申請を行った清算参加者は、物価連動国債を割当対象銘柄とするバスケット銘柄についても実施が可能です。

また、RT2-1、RT2-2では、**国債バスケット(分離元本・分離利息)を繰越確認専用バスケット(項番6で記載)**といたします。

項番1のテストケースでは国債バスケット(分離元本・分離利息)を約定せず、割当可能残高通知データへ分離元本振替国庫債券、分離利息振替国庫債券を含めないでください

※1:債務引受時にJSCCが参加者に通知する電文は、以下です。(項番2~5を除く)

- 債務引受一覧通知データ(バスケット)(02-0239110x-39000)
- ネットティング結果通知データ(バスケット)(02-0239120x-39000)
- ネットティング明細通知データ(バスケット)(02-0239130x-39000)
- ネットティング結果通知データ(個別銘柄)(02-0239150x-39000)
- ネットティング明細通知データ(個別銘柄)(02-0239160x-39000)
- 銘柄割当明細通知データ(02-0239140x-39000)
- DVP決済予定通知データ(後決め)(02-0239170x-39000)

※2:JSCCから受信電文についてJSCCの参加者端末からダウンロードして確認も可能です。

※3:DVP 決済(後決め)につきましては、JSCCよりDVP 決済予定通知データ(後決め)通知完了後、速やかに国債資金同時受渡依頼(指示なし)を送信します。

【項番2 FOS決済】

テストケース	項目	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考	
a	FOS決済予定通知データ(02-0239070x-39000)受信(※2)	ほふり	RT2-1	15:00~17:00		
b	FOS決済(受取)(※3)	日銀	RT2-1、 RT2-2	9:00~10:00	RT2-1でFOS決済を行う場合は、あらかじめ提示したFOS決済予定通知データに基づき実施してください	
	振替依頼(INQ211101)送信			10:30~11:00		
	当座勘定振替済通知(RES2111-00600)受信					
	FOS決済(支払)(※3)					
c	当座勘定入金通知(EX2111-00200)受信	ほふり		13:00~13:30	FOS決済(後決め)は約定内容により受取か支払か決定されます	
	FOS決済予定通知データ(後決め分)(02-0239180x-39000)受信(※2)			13:00~14:00		
d	FOS決済(後決め)(受取)(※3)	日銀	RT2-1、 RT2-2	13:00~14:00		
	振替依頼(INQ211101)送信			14:00~14:30		
	当座勘定振替済通知(RES2111-00600)受信					
	FOS決済(後決め)(支払)(※3)					
	当座勘定入金通知(EX2111-00200)受信					

【項番3 当初証拠金決済】

テストケース	項目	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
a	当初証拠金通知データ(02-0239050x-39000)(1回目分)受信(※2)	ほふり	RT2-1、 RT2-2	9:00~9:30	
	当初証拠金通知データ(02-0239200x-39000)(2回目分)受信(※2)			11:00~11:30	
	当初証拠金通知データ(02-0239200x-39100)(3回目分)受信(※2)			13:00~13:30	
b	当初証拠金の現金の差入	日銀	RT2-1、 RT2-2	1回目 9:00~10:00 2回目 11:00~13:00 3回目 13:00~14:30	
	振替依頼(INQ211101)送信				
	当座勘定振替済通知(RES2111-00600)受信				
	当初証拠金の代用有価証券の差入(※)				
	口座振替(INQ743101)送信	JSCCの 参加者端末		現金及び代用有価証券とともに、残高の範囲内で返戻依頼が可能です	
	国債振替決済払出済通知(RES7411-00100)受信				
	当初証拠金の返戻依頼				
現金の返戻(当座勘定入金通知(EX2111-00200)受信)	日銀	1回目 10:00~10:30			
代用有価証券の返戻(国債振替決済払出済通知(EX7411-00200)受信)		2回目 13:00~13:30 3回目 14:30~15:00			

【項番4 清算基金決済】

テストケース	項目	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
a	清算基金通知データ(02-0239190x-39000)受信(※2)	ほふり	RT2-1	15:00~17:00	
b	清算基金の現金の差入	日銀	RT2-1、 RT2-2	9:00~10:00	RT2-1で清算基金決済を行う場合は、あらかじめ提示した清算基金通知データに基づき実施してください
	振替依頼(INQ211101)送信				
	当座勘定振替済通知(RES2111-00600)受信				
	清算基金の代用有価証券の差入(※)				
	口座振替(INQ743101)送信				
	国債振替決済払出済通知(RES7411-00100)受信				
清算基金の返戻依頼	JSCCの 参加者端末			現金及び代用有価証券とともに、残高の範囲内で返戻依頼が可能です	
現金の返戻(当座勘定入金通知(EX2111-00200)受信)	日銀		10:00~10:30		
代用有価証券の返戻(国債振替決済払出済通知(EX7411-00200)受信)					

【項番5 終了通知】

テストケース	項目	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考
a	終了通知データ(02-0239210x-39000)(1回目)受信	ほふり	RT2-1、 RT2-2	9:00~9:30	ほふりとの接続が統合Web端末のみ利用してのテスト参加者は、確認対象外となります
	終了通知データ(02-0239210x-39000)(2回目)受信			11:00~11:30	
	終了通知データ(02-0239210x-39000)(3回目)受信			13:00~13:30	
	終了通知データ(02-0239210x-39000)(4回目)受信			14:30~15:00	
	終了通知データ(02-0239210x-39000)(5回目)受信			15:00~17:00	

※物価連動国債の手数料選択申請を行った清算参加者は、物価連動国債を割当対象銘柄とするバスケット銘柄についても実施ください

※2: JSCCからの受信電文についてJSCCの参加者端末からダウンロードして確認も可能です

※3: FOS決済、FOS決済(後決め)における(受取)はJSCCの受取、(支払)はJSCCの支払となります。

【項番6 繰越機能等】

<テストケース a-1 繰越、超過割当、フェイルと続く一連の確認>

渡方	受方	項目	実施主体	接続先	確認可能 タイミング	確認可能時間帯 (実時刻)	備考		
参加者A	参加者B	売買報告データ(国債／現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信	渡方	ほふり	RT2-1	9:00～11:00	国債バスケット(分離元本・分離利息)で約定してください		
		売買報告データ(国債／現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信	受方						
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方						
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信	渡方						
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)							
		2回目債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				11:00～11:30	国債バスケット(分離元本・分離利息)のバスケットポジションが繰越されていることを確認してください	
		3回目債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方				13:00～13:30	2回目から繰越された国債バスケット(分離元本・分離利息)のバスケットポジションが超過割当されたことを確認してください	
		3回目債務引受時に超過割当されたDVP決済予定に関する 国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方				日銀	13:00(※3)～ 14:00	フェイルとするため超過割当された銘柄についてDVP決済を実施しないでください
		3回目債務引受時に超過割当されたDVP決済予定に関するDVP1(未実施)	渡方						
		3回目債務引受時に超過割当されたDVP決済予定に関するDVP2(未実施)	受方						
		ネットイング結果通知データ(フェイル)(個別銘柄)(02-0239150x-39100)、DVP決済予定通知データ(フェイル)(後決め)(02-0239170x-39100)受信(※2)	渡方・受方	日銀	14:30～15:00				
		売買報告データ(国債／現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信	渡方	ほふり	9:00～11:00	渡し方、受け方をRT2-1と逆にする等、必要に応じて国債バスケット(分離元本・分離利息)で約定してください			
		売買報告データ(国債／現先(銘柄後決め方式))(01-0133020x-33000)送信	受方						
		債務認定結果通知データ(バスケット)(02-0239090x-39000)受信(※2)	渡方・受方						
		割当可能残高通知データ(01-0133270x-33000)送信	渡方						
		割当可能残高通知データ受付通知データ(02-0239080x-39000)受信(※2)							
		RT2-1でフェイルとなった超過割当されたDVP決済予定に関する 国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	9:00(※3)～ 10:30	フェイルとするため超過割当された銘柄についてDVP決済を実施しないでください			
		RT2-1でフェイルとなった超過割当されたDVP決済予定に関するDVP1(未実施)	渡方						
RT2-1でフェイルとなった超過割当されたDVP決済予定に関するDVP2(未実施)	受方								

	2回目債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方	ほふり	RT2-2	11:00～11:30	RT2-2で国債バスケット(分離元本・分離利息)を約定した場合、国債バスケット(分離元本・分離利息)のバスケットポジションが繰越されていることを確認してください
	3回目債務引受時におけるJSCCからの通知電文(※1)受信(※2)	渡方・受方			13:00～13:30	RT2-2で国債バスケット(分離元本・分離利息)を約定した場合、2回目から繰越された国債バスケット(分離元本・分離利息)のバスケットポジションが超過割当されたことを確認してください
	3回目債務引受時に超過割当されたDVP決済予定に関する 国債資金同時受渡依頼受付案内(7511-00200)受信	渡方・受方	日銀	13:00(※3)～ 14:00	RT2-2で国債バスケット(分離元本・分離利息)を約定した場合、フェイルとするため超過割当された銘柄についてDVP決済を実施しないでください	
	3回目債務引受時に超過割当されたDVP決済予定に関するDVP1(未実施)	渡方				
	3回目債務引受時に超過割当されたDVP決済予定に関するDVP2(未実施)	受方				

※1: 債務引受時にJSCCが参加者に通知する電文は、以下です。(項番2～5を除く)

債務引受一覧通知データ(バスケット)(02-0239110x-39000)
 ネットティング結果通知データ(バスケット)(02-0239120x-39000)
 ネットティング明細通知データ(バスケット)(02-0239130x-39000)
 ネットティング結果通知データ(個別銘柄)(02-0239150x-39000)
 ネットティング明細通知データ(個別銘柄)(02-0239160x-39000)
 銘柄割当明細通知データ(02-0239140x-39000)
 DVP決済予定通知データ(後決め)(02-0239170x-39000)

※2: JSCCから受信電文についてJSCCの参加者端末からダウンロードして確認も可能です。

※3: DVP 決済(後決め)につきましては、JSCCよりDVP 決済予定通知データ(後決め)通知完了後、速やかに国債資金同時受渡依頼(指示なし)を送信します。