

2017 年 11 月（改訂版）

# 総合運転試験（RT）に関する「実施手順書」 ＜フェーズ 3 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3編>

<b>1. テスト概要</b> .....	<b>2</b>
(1) 市場取引 .....	2
(2) 国債の入札・発行払込.....	5
(3) 日銀オペ .....	7
<b>2. 運行スケジュール</b> .....	<b>8</b>

## 1. テスト概要

### (1) 市場取引

- 「市場取引」に係るテストの概要は、以下のとおりです。

#### (テスト参加対象先)

参加必須	<ul style="list-style-type: none"> <li>JSCC の国債店頭取引清算資格を取得している市場参加者*</li> </ul>
参加が望ましい	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資信託・投資顧問等のバック事務を信託銀行等に外部委託している先</li> <li>アウトライト等の T+1 化のためにシステム改修又は事務体制の見直しを実施した先</li> <li>T+1 化を機に新現先方式による先決めレポ取引を新たに開始する先</li> </ul>

※ アウトライト T+1 化等、後決めレポ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 の利用を開始する場合にもフェーズ3にご参加ください。

#### (テスト内容)

- 全体的な総合テストの位置付けとして、可能な限り決済期間短縮化後に想定される市場環境や取引に近いものとなるようにすることで、業務全般の確認を実施。

—— テストの相手方・テスト内容の詳細は、RT 連絡会等の場を活用の上、市場参加者において、各々、ご調整頂くこととなります（調整にあたっては、参考1、参考2もご参照ください）。

—— 後決めレポに係る決済処理については、日銀ネット利用細則（国債資金同時受渡関係事務）をご参照ください。

## (参考 1)

- ・ RT フェーズ 3 における市場取引のテストは、決済期間の短縮と後決めレポの導入を中心とした新たな市場慣行<sup>※</sup>の下、フロント部署を含めた事務・システム面のフィージビリティを確認することを主な目的としております。

※ T+1 化後の決済に係る各種事務処理時限等を定める市場慣行の改正等については、2015 年 11 月、日証協において決定・公表されております ([http://www.jsda.or.jp/katsudou/public/kekka/files/151118rtgs\\_shiryoku.pdf](http://www.jsda.or.jp/katsudou/public/kekka/files/151118rtgs_shiryoku.pdf))。

参考：国債取引のポストトレード事務の電子化・標準化の実務に関する取扱指針

[http://market.jsda.or.jp/shiraberu/saiken/kessai/rtgs/rtgs/files/posttrade\\_shishin.pdf](http://market.jsda.or.jp/shiraberu/saiken/kessai/rtgs/rtgs/files/posttrade_shishin.pdf)

- ・ その際、実効性の高い RT を実施する観点から、テストの相手方・テスト内容等の検討・調整については、通常取引関係等を踏まえて、市場参加者において、各々、対応していただくこととなります。
- ・ こうした市場参加者におけるテストの相手方・テスト内容等の検討・調整に関する作業を支援する観点から、「RT 連絡会」<sup>※</sup>を設置しています。

※ RT 連絡会では、レポ市場の主要な市場参加者を中心として、今後の各種調整の方法等に係る認識共有や、具体的なテスト内容(対象取引やシナリオ作成等)の各種調整を行っていただき、全体の参考となる事項については適宜フィードバックしていくことを想定しています。

- ・ なお、市場参加者の業態・取引規模等に応じて、テストが必要となる取引の量・種類等が大きく異なることを踏まえて、国債 T+1 化 WG として、テストの相手方のマッチングや市場全体としての統一シナリオの策定等を行いません。
- ・ 市場インフラ(ほふり、JSCC、日銀)は、RT フェーズ 3 の全日程において、市場参加者が市場取引に係る国債 DVP 決済等(資金振替、国債 FOP 決済等を含む。)を行える環境を提供します。

## (参考 2)

- ・ 市場参加者におけるテスト内容の検討において、フェーズ 3 で確認すべき必須メニュー、任意メニューに関する基本的な考え方は、以下のとおりです。

## &lt;必須メニュー&gt;

後決めレポを行う先：後決めレポの約定・unwind/rewind・決済に係る連続する営業日の業務テスト（証拠金の差入・返戻や FOS 決済等を含む。）、アウトライイト取引 and/or 先決め SC レポ取引（以下、アウトライイト等）の約定・決済に係る連続する営業日の業務テストを最低 1 回は実施してください。

## &lt;任意メニュー&gt;

「必須メニュー」以外の取引に係る業務テストの実施は、参加者同士の合意の下、全て任意で実施することが可能です。

[特にテスト実施が望ましいと考えられるケース]

JSCC 清算参加者：物価連動国債を取り扱う先は、約定・決済について最低 1 回実施することが望ましいと考えています。

システム改修や事務体制の見直しを実施した先：アウトライイト等の約定・決済に係る連続する営業日の業務テストを最低 1 回実施することが望ましいと考えています。

新現先方式による先決めレポ取引を新たに開始する先：RT 前に（通常の実取引において）テスト・ディール等を行ったり、フェーズ 3 の機会を利用し、事務体制・システムのフィージビリティを確認すると共に、事務の習熟度向上を図っていくことが望ましいと考えています。

## &lt;テスト対象外の取引&gt;

- 非市場性の資金取引（内為、外為円等）
- 資金のみの市場取引（無担コール等、その他）
- 国債と紐付くレポ以外の市場取引（有担コール等、その他）
- CCP 担保（ただし、JSCC の国債店頭取引に係る担保の授受はテストの対象とする。）
- 非居住者取引<sup>1</sup>

<sup>1</sup> 在庫玉の管理等を実効的に確認する観点から、テスト参加者のニーズに応じて任意メニューに組み込むことが出来ませんが、非居住者自身のテスト参加は想定していません。

## (2) 国債の入札・発行払込

- ・ 「国債の入札・発行払込」に係るテストの概要は、以下のとおりです（詳細は別紙4-1をご確認ください）。

### (テスト参加対象先)

- ① 国債市場特別参加者及びその払込受託者は、第1回（RT3-1）及び第2回（RT3-2）で行う全てのテストに必ず参加してください。
- ② 払込委託者（国債市場特別参加者を除きます）及びその払込受託者並びに普段応札している先は、普段の応札状況を踏まえて実際に応札することが想定される入札に係るテストに極力参加してください。払込委託者におかれては、参加の要否について払込受託者と十分に連絡をとってください。
- ③ 上記以外の入札参加者については、任意参加とします。

## (テスト内容)

■ 「国債の入札・発行払込」のテストでは、国債発行市場における T+1 化後の事務フローを想定し、国債の入札への応募から新規記録事項等の通知に係る一連の事務を同日中（T 日中）に行います\*。

※ RT の対象となる事務は、入札日中（T 日中）の新規記録等の送信までとなります。入札日翌日（T+1 日）の発行日の事務（払込金額の払込）については、テスト参加者が任意で行うことが出来ます<sup>2</sup>が、RT の対象ではありません。

—— RT 全体として予備日を使用しない場合であっても、「国債の入札・発行払込」のみ、再テストを実施する場合があります<sup>3</sup>。

—— なお、「国債の入札・発行払込」のテストでは、当該テストに参加しない入札参加者に対しても、「国債入札実施要項通知」を送信します。「国債の入札・発行払込」のテスト不参加の入札参加者は、以降のオペレーション（入札要項の送信等）は不要です。

---

<sup>2</sup> ただし、「国債の入札・発行払込」のテストで使用する一部架空銘柄（国庫短期証券）については、市場取引の決済で利用することは出来ませんので、払込金額の払込を行わないでください。

<sup>3</sup> 「国債の入札・発行払込」のみの再テストについて、RT 全体としての予備日を使用する予定はありません。

### (3) 日銀オペ

- ・ 「日銀オペ」に係るテストの概要は、以下のとおりです（詳細は別紙4-2、4-3をご確認ください）。

#### (テスト参加対象先)

- 日本銀行の国債系オペ対象先及びその決済代行先であって、後決めレポを実施する先は、フェーズ3で実施されるオペのオファーからスタート決済に係る一連の業務テストに原則として参加することが望ましい。

#### (テスト内容)

- 「日銀オペ」のテストでは、国債買入オペ及び国債補完供給について、オファーからスタート決済までの一連の事務を確認することとします。
- 国債買入オペについては、T+1としてオファーします。
- 国債補完供給については、テストの対象はオファーからスタート決済までとします。エンド決済については、必要に応じて行うことも出来ますが、実施は必須とはしません。

—— RT全体として予備日を使用しない場合であっても、「日銀オペ」のみ、再テストを実施する場合があります<sup>4</sup>。

—— なお、「日銀オペ」のテストでは、当該テストに参加しないオペ対象先に対しても、「入札要項通知」を送信します。「日銀オペ」のテスト不参加のオペ対象先は、以降のオペレーション（「入札要項通知」受信の旨の送信等）は不要です。

<sup>4</sup> 「日銀オペ」のみの再テストについて、RT全体としての予備日を使用する予定はありません。

## 2. 運行スケジュール

- 市場インフラ（ほふり、JSCC、日銀）は、テスト当日、テスト用に「9時~17時」の間、システムを運行します。
- 当該時間帯の中で必要なテストを実施して頂く観点から、フェーズ3における事務・システム処理の時間帯は、RT日の実時刻ベースで以下の通りとします（詳細は別紙4-4参照）。

		RT日実時刻	想定時刻 <sup>5</sup>	留意事項
市場取引		9:00~17:00	7:00~21:00	<ul style="list-style-type: none"> <li>市場取引・日銀オペの時刻の読み替え方は同一です。</li> <li>国債の入札・発行払込は、市場取引・日銀オペとは時刻の読み替え方が異なりますので、ご注意ください（次頁（参考）参照）。</li> <li>自社の予定する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。別途、手順書に定める結果報告書をご提出ください（電話連絡等は不要です）。</li> </ul>
アウトライト・先決めレポ (JSCC 関連 <sup>6</sup> )	DVP1	9:50~13:00	9:00~13:30	
	DVP2	9:50~13:30	9:00~14:00	
FOS 決済（後決めレポ以外）	JSCC 受取	9:50~10:10	9:00~10:00	
	JSCC 支払	10:40~11:00	10:30~11:00	
後決めレポ 1 回目決済	DVP1	9:50~10:40	9:00~10:30	
	DVP2	9:50~11:00	9:00~11:00	
後決めレポ 2 回目決済	DVP1	11:00~13:00	11:00~13:30	
	DVP2	11:00~13:30	11:00~14:00	
後決めレポ 3 回目決済	DVP1	13:30~14:30	14:00~15:30	
	DVP2	13:30~15:00	14:00~16:00	
FOS 決済（後決めレポ）	JSCC 受取	13:30~14:30	14:00~15:30	
	JSCC 支払	15:00~15:10	16:00~16:30	
JSCC フェイル通知		15:15~15:45	17:00~17:30	
JSCC 夜間バッチ処理		16:00~17:00	18:30~21:00	
日銀オペ		10:20~15:15	10:10~17:00	
国債の入札・発行払込		10:30~16:30	10:20~17:00	

<sup>5</sup> T+1 化後、実際に事務・システム処理が行われる時間帯。

<sup>6</sup> 非 JSCC 取引の国債決済は、RT 日実時刻ベースで 17:00 まで行うことが可能です。このため、照会機能のみが利用可能となる時間帯はありませんので、ご注意ください。

(参考：RT 日実時刻の想定時刻への読み替えに係る考え方)

RT 日実時刻	想定時刻		時刻読み替えに係る考え方
	市場取引・日銀オペ	国債の入札・発行払込	
9:00	7:00	市場取引・日銀オペ 想定時刻と同一	<ul style="list-style-type: none"> <li>・通常7時～21時に行われる事務処理・システム処理を、RT日には9時～17時で実施するため、RT日実時刻の想定時刻への読み替えにおいては、以下の時間帯について時間の短縮を行っています。</li> </ul>
9:50	9:00		
10:10	10:00		
10:30	10:20		
10:40	10:30		
11:00	11:00		
12:00	12:00		
12:20	12:30		
12:30	13:00		
13:00	13:30		
13:30	14:00		
14:00	14:30		
14:30	15:30		
15:00	16:00		
15:10	16:30		
15:15	17:00		
15:45	17:30		
16:00	18:30		
16:30	19:45	17:00	<ul style="list-style-type: none"> <li>(国債の入札・発行払込)</li> <li>・①～⑤については、市場取引・日銀オペと同様です。想定時刻14:00 (RT日実時刻13:30) 以降については時間の短縮を行いません(詳細は、別紙4-1をご確認ください)。</li> </ul>
17:00	21:00		

以 上

---

総合運転試験（RT）実施手順書  
＜国債の入札・発行払込（フェーズ3）＞

---

第1回（RT3-1）：2018年1月14日

第2回（RT3-2）：2018年2月4日

＜実施時間帯：10:30～16:30＞

＜事前照会先＞

日本銀行 業務局 総務課営業・国債業務企画グループ

TEL:03-3277-2843（直通） 坂田（サカタ）、市川（イチカワ）

(はじめに)

1. 本手順書は、「国債の入札・発行払込<sup>1</sup>」のテストで使用する手順書です。
2. 「国債の入札・発行払込」のテストでは、国債発行市場における T+1 化後の事務フローを想定し、国債の入札への応募から新規記録事項等の通知にかかる一連の事務を同日中 (T 日中) に行います。第 1 回および第 2 回のテストでは、入札対象国債等を変えて実施します。
3. 「国債の入札・発行払込」のテストにつき、ご不明な点があれば、表紙に記載した「事前照会先」にご連絡ください。
4. テスト参加者におかれては、本手順書を事前にご確認いただき、RT についての理解を深めていただきますよう、お願いいたします。テスト実施にあたっては、本手順書のほか、「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則 (国債発行関係事務)」(以下「利用細則」といいます) をご覧いただき、日銀ネットの端末操作手順等をご確認願います。
5. RT 当日は、極力本番業務に近い形でテストを実施してください。例えば、発行払込の事務を払込受託者に委託している入札参加者 (払込委託者) におかれては、当該受託者との連絡も行っていただくなど、本番業務を見据えた RT を実施してください。

---

<sup>1</sup> 本手順書における「発行払込」とは、払込者が新規記録事項等の通知を行うことをいい、発行日における払込金額の払込および国債の新規記録 (同時担保差入が行われた場合には、その担保受入およびこれにかかる振替を含みます) は対象となりません。以下同じです。

## 目次

1. 概要	1
(1) 日程	1
(2) テスト内容	1
2. RT の参加対象先	4
3. RT のタイムスケジュール	5
(1) T+1 化後の想定時刻および RT における時刻の読み替え	5
(2) RT の実施スケジュール	7
4. RT のメイン・シナリオ	9
(1) テスト方法等	9
(2) テストデータ	10

別添「操作手順書編」

## 1. 概要

### (1) 日程

- RT（フェーズ3）における国債の入札・発行払込のテストの日程は、次表のとおりです。

実施回	実施予定日	システム日付
第1回（RT3-1）	2018年1月14日（日）	2017年9月15日
第2回（RT3-2）	2018年2月4日（日）	2017年9月19日
再テスト（RT3-3）	2018年2月18日（日）	2017年9月20日

—— テスト結果等によって、当初予定したテスト内容が変更となることも想定されます。

—— 第1回、第2回において予定のテストが行えなかった等の理由により RT3-3 に再テストを実施することとなった場合には、テスト参加者にご連絡します。

### (2) テスト内容

- 国債発行市場における T+1 化後に想定される事務フローでは、T+1 化の対象となる国債の入札において、払込者が日銀ネットを利用して新規記録事項等の通知を行うタイミングが募入決定通知日の 17 時までとなるのが大きな変更点の一つとなります（現行は募入決定通知日の翌営業日から発行日前営業日の 15 時まで）。
- 本テストでは、上記の変更点等を踏まえた事務フローの確認を行います。なお、当該事務変更にかかる日銀ネットの端末操作手順に変更はありません。

○ 本テストの対象となる事務の種類および入札対象国債等は、次表①および②のとおりです。

① 事務の種類

事務の種類	内容（概要）	日銀ネットの入力	
		業務処理区分	業務処理区分コード
A. 国債の入札への応募	T+1 化の対象となる国債の入札へのオンライン応募を行います。なお、当該事務は <u>入札参加者</u> が行います。	[国債発行] <入札発行> 入札要項	721101
B. 入札結果の確認	日本銀行から通知される入札結果（募入決定通知）の確認を行います。なお、当該通知は <u>入札参加者</u> に対して行われます。	—	—
C. 新規記録事項等の通知	募入となった国債についてオンライン新規記録等を行います。なお、当該事務は <u>払込者</u> が行います。	[国債発行] <発行共通> 新規記録等	721301

— 本テストでは、T+1 化後に想定される A. から C. までの T 日の事務を、一連の事務フローとして同日中に行います。

— 次の事務は RT の対象としていませんので実施は必須ではありませんが、希望するテスト参加者において任意で行うことができます。なお、当該事務にかかる日銀ネットの端末操作手順に変更はありません。

- ・ 代行払込先における発行日前営業日に受信する通知の確認。
- ・ 一部銘柄<sup>2</sup>について、払込者における発行日に行う払込金額の払込<sup>3</sup>（ただし、自行払込および代行払込の場合

<sup>2</sup> 詳細は 3.（2）RT の実施スケジュールをご覧ください。

合に限ります)。

② 入札対象国債等

	国債の種類等	入札の方法
第 1 回	国庫短期証券	・ 価格競争および第 I 非価格競争
	利付国庫債券 (10 年)	・ 価格競争、非競争および第 I 非価格競争 ・ 第 II 非価格競争
第 2 回	国庫短期証券	・ 価格競争および第 I 非価格競争
	流動性供給入札	・ 利回格差競争

—— 本テストに使用する銘柄情報については 4. (2) テストデータをご覧ください。なお、国庫短期証券は、架空銘柄を使用し、利付国庫債券 (10 年) および流動性供給入札にかかる国債は本テストのシステム日付時点において実在する銘柄を使用します。

<sup>3</sup> 第 1 回の国債の入札にかかる払込金額の払込は RT3-2 に、第 2 回の国債の入札にかかる払込金額の払込は RT3-3 に行うことができます。なお、払込金額の払込 (「払込 OK サイン (業務処理区分 : 721302)」または「代行払込 OK サイン (業務処理区分 : 721401)」の送信) は 9 : 35 以降に可能となります。

## 2. RT の参加対象先

- 入札参加者の区分に応じ、参加範囲は次のとおりとなります。
  - ① 国債市場特別参加者およびその払込受託者は、第1回（RT3-1）および第2回（RT3-2）で行う全てのテストに必ず参加してください。
  - ② 払込委託者（国債市場特別参加者を除きます）およびその払込受託者ならびに普段応札している先は、普段の応札状況を踏まえて実際に応札することが想定される入札にかかるテストに極力参加してください。払込委託者におかれては、参加の要否について払込受託者と十分に連絡をとってください。
  - ③ 上記以外の入札参加者については、任意参加とします。
- なお、RTに1回のみ参加する先は、RTに問題が生じた場合に追加的に参加できる機会を確保するため、極力第1回（RT3-1）に参加してください。

### 3. RTのタイムスケジュール

#### (1) T+1化後の想定時刻およびRTにおける時刻の読み替え

- T+1化後における想定時刻を次表の実時刻に読み替えたうえで、テストを実施します<sup>(注1)</sup>。

想定時刻 <sup>(注2)</sup>	実時刻	イベント		
		国庫短期証券	利付国庫債券(10年)	流動性供給入札
10:20	10:30	オファー	—	—
10:30	10:40	—	オファー①	オファー
11:30	11:30	応募締切	—	—
11:50	11:50	—	応募締切①	応募締切
12:30	— <sup>(注3)</sup>	入札結果公表	—	—
12:35	— <sup>(注3)</sup>	—	入札結果公表①	入札結果公表
14:00	13:30	—	オファー② (第Ⅱ非価格競争)	—
14:30	14:00	—	応募締切②	募入決定通知 <sup>(注4)</sup>
15:00	14:30	募入決定通知 <sup>(注5)</sup>	募入決定通知① <sup>(注6)</sup>	—
15:15	— <sup>(注3)</sup>	—	入札結果公表② (第Ⅱ非価格競争)	
15:50	15:20		募入決定通知② <sup>(注6)</sup>	
17:00	16:30	新規記録等の送信の締切		
17:00頃	16:30頃	国債代行払込依頼額取りまとめ通知 <sup>(注7)</sup>		

(注1) 全てのテスト参加者において、10:30 から 16:30 までの時間帯は日銀ネットを通じた当日取引を可能とする事務処理態勢が確保されていることを前提にテストを実施しますので、テスト参加者は10:30までに次の作業を実施してください。

- ・ 端末の起動、センターとの接続およびサインオン
- ・ 自社システムを使用する先は、自社システムの立上げ

(注2) 想定時刻は、財務省が公表した「決済期間の短縮化 (T+1 化) 後における入札のタイムテーブル」に基づく時刻です。詳細は財務省ホームページ (国債市場特別参加者会合 (第 68 回) 議事要旨 3. および資料 2) をご参照ください。 ([http://www.mof.go.jp/about\\_mof/councils/meeting\\_of\\_jgbsp/proceedings/outline/161125.html](http://www.mof.go.jp/about_mof/councils/meeting_of_jgbsp/proceedings/outline/161125.html))

(注3) RT では財務省による入札結果公表は行われません。

(注4) 「新規記録等」の入力データの送信は募入決定通知から 10 分経過後 (実時刻 14:10 以降) より可能となります。

(注5) 「新規記録等」の入力データの送信は募入決定通知から 10 分経過後 (実時刻 14:40 以降) より可能となります。

(注6) 第Ⅱ非価格競争への応募の有無にかかわらず、「新規記録等」の入力データの送信は募入決定通知②から 10 分経過後 (実時刻 15:30 以降) より可能となります。

(注7) 払込者が、代金払込方法として「代行払込」を選択した場合には、指定を受けた代行払込先に「国債代行払込依頼額取りまとめ通知」が送信されます。当該通知の確認は RT の対象としていませんので必須ではありませんが、希望するテスト参加者において任意で行うことができます。

## (2) RTの実施スケジュール

○ 本手順書が対象とするRTにおけるテストは、以下のスケジュールに沿って実施します。

【第1回（1月14日）】国庫短期証券の入札および利付国庫債券（10年）の入札（第Ⅱ非価格競争を含みます）の実施スケジュール

実時刻	国庫短期証券	実時刻	利付国庫債券（10年）	実時刻	第Ⅱ非価格競争		
～10:30	端末の立ち上げ等						
10:30	オファー	↓	オファー	/			
↓	応募締切	10:40					
11:30		↓				応募締切	
↓	募入決定通知	↓	募入決定通知	13:30	オファー		
↓		↓		↓	↓	14:00	応募締切
↓		↓		↓	↓	↓	募入決定通知
↓		↓		↓	↓	15:20	
↓		↓		↓	↓		
16:30	新規記録等の送信 <sup>(注)</sup> の締切						

(注) 「新規記録等」の入力データの送信はそれぞれ次の実時刻より可能となります。

- ・国庫短期証券： 14：40以降
- ・利付国庫債券（10年）： 15：30以降

—— なお、本テストで「新規記録等」の送信を行った利付国庫債券（10年）については、RT3-2において払込金額の払込を行い、市場取引の決済で利用することが可能です。他方で、架空銘柄を使用する国庫短期証券については、市場取引の決済で利用することができませんので、払込金額の払込を行わないでください。

【第2回（2月4日）】国庫短期証券の入札および流動性供給入札の実施スケジュール

実時刻	国庫短期証券	実時刻	流動性供給入札
～10:30	端末の立ち上げ等		
10:30	オファー	↓	オファー
↓	応募締切	10:40	
11:30		↓	11:50
↓	募入決定通知	↓	募入決定通知
↓		↓	
↓		↓	
↓		14:00	
14:30	↓	↓	
↓		↓	
↓		↓	
16:30	新規記録等の送信 <sup>(注)</sup> の締切		

(注) 「新規記録等」の入力データの送信はそれぞれ次の実時刻より可能となります。

- ・国庫短期証券： 14：40以降
- ・流動性供給入札： 14：10以降

—— なお、本テストで「新規記録等」の送信を行った流動性供給入札にかかる国債については、RT3-3において払込金額の払込を行い、市場取引の決済で利用することが可能です。他方で、架空銘柄を使用する国庫短期証券については、市場取引の決済で利用することができませんので、払込金額の払込を行わないでください。

#### 4. RT のメイン・シナリオ

##### (1) テストの方法等

- テスト参加者は、3.(2) RT の実施スケジュールに基づき、オファーにかかる国債の入札への応募（「入札要項（業務処理区分：721101）」の入力・送信）を行ったうえで、募入決定通知により所定の時間内に新規記録事項等の通知（「新規記録等（業務処理区分：721301）」の入力・送信）を行います。本テストでは、テストに参加した全ての払込者が新規記録事項等の通知を行うことができる入札結果となるよう、本行が予め指定した入力内容に基づき入札への応募を行っていただきます。
  
- 本テストにかかる日銀ネットの入力内容および留意事項は、別添「操作手順書編」および利用細則をご覧ください。
  - RT 当日に速やかにデータの送信を行えるよう、RT 前日までに入力内容の確認等所要の準備をしてください。

## (2) テストデータ

○ 本テストで使用する銘柄情報は次表のとおりです。国庫短期証券については架空銘柄を使用します。

	国債名称記号	銘柄コード	発行日	利率 (%)	利子支払期 (月日)	償還期限
第1回	国庫短期証券第900回	JP1749001H99	29.09.19	—	—	29.12.19
	利付国庫債券(10年)第343回	JP1103431G66	29.09.19	0.1	6/20、12/20	38.06.20
第2回	国庫短期証券第901回	JP1749011H97	29.09.20	—	—	29.12.20
	(流動性供給入札)					
	利付国庫債券(10年)第325回～第344回	—	29.09.20	—	—	—
	利付国庫債券(20年)第58回～第142回					
	利付国庫債券(30年)第1回～第45回					

— 流動性供給入札(利回格差競争)における銘柄毎の基準利回りは、平成29年9月19日付で日本証券業協会が発表する公社債店頭売買参考統計値表に掲載された平均値の単利利回り(同日午前9時以前に訂正された場合には、訂正後の当該単利利回り)とします。

以 上

## 操作手順書編

【 事 務 】 国債の入札・発行払込（フェーズ 3）

【 実施回 】 第 1 回（RT3-1）、第 2 回（RT3-2）

（留意点）

- 本手順書は、「国債の入札・発行払込」のテストで使用する操作手順書です。
- 本テストは、全てのテスト参加者が国債の入札への応募から新規記録事項等の通知までの一連の事務を行うシナリオになっています。シナリオどおりテストを行っていただくため、本手順書に日銀ネットの入力内容について指定がある項目は、その内容を入力するよう、ご協力お願いいたします（入力内容は入札参加者の区分により異なります）<sup>（注）</sup>。  
（注）本テストでは、応募限度額の設定額等、一部に通常のと扱いは異なる点がありますが、これは、指定内容を入力していただくことにより、各テスト参加者に応募内容と同様の募入結果が通知されるシナリオとするためです。詳細は 1. の各【対象銘柄等】をご覧ください。
- 本テストは、本手順書のほか「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（国債発行関係事務）」（以下「利用細則」といいます）に基づき実施してください。

## 目次

記載項目	頁
1. 国債の入札への応募	1
（1）国庫証券＜価格競争および特別参加者第Ⅰ非競争＞【第1回、第2回共通】	1
（2－1）利付国（10年）＜価格競争、非競争および特別参加者第Ⅰ非競争＞【第1回】	3
（2－2）利付国（10年）＜特別参加者第Ⅱ非競争＞【第1回】	5
（3）特別参加者流動性供給＜利回格差競争＞【第2回】	6
2. 入札結果の確認【第1回、第2回共通】	8
3. 新規記録事項等の通知【第1回、第2回共通】	9

1. 国債の入札への応募（国庫証券および利付国債の入札ならびに流動性供給入札にかかる事務）

(1) 国庫証券＜価格競争および特別参加者第 I 非競争＞（10:30～11:30）【第 1 回、第 2 回共通】

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック																								
—	—	<p><b>【対象銘柄等＜第 1 回＞】</b></p> <table border="1" data-bbox="602 331 1573 1024"> <tr> <td>対象銘柄（略称）</td> <td>国庫証券 第 900 回</td> </tr> <tr> <td>銘柄コード</td> <td>JP1749001H99</td> </tr> <tr> <td>発行方法</td> <td>16 価格競争および特別参加者第 I 非競争</td> </tr> <tr> <td>入札日</td> <td>29. 9. 15</td> </tr> <tr> <td>発行日</td> <td>29. 9. 19</td> </tr> <tr> <td>償還期限</td> <td>29. 12. 19</td> </tr> <tr> <td>発行予定額</td> <td>2 兆 8, 600 億円程度 <sup>(注)</sup></td> </tr> <tr> <td>競争入札の応募限度額</td> <td>100 億円</td> </tr> <tr> <td>第 I 非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額</td> <td>一律 200 億円</td> </tr> <tr> <td>応募価格の単位</td> <td>5 毛刻み</td> </tr> <tr> <td>応募額一口の金額</td> <td>・価格競争入札および第 I 非競争入札…10 百万円</td> </tr> <tr> <td>発行価格の決定方法</td> <td>各募入価格</td> </tr> </table> <p>(注) 予告なく変更する可能性があります。RT 当日の「国債入札実施要項通知」でご確認願います。</p> <p><b>【対象銘柄等＜第 2 回＞】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 上記の表のうち、次の事項を読み替えてください。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・対象銘柄（略称）：国庫証券 第 901 回</li> <li>・銘柄コード：JP1749011H97</li> <li>・入札日：29. 9. 19、発行日：29. 9. 20、償還期限：29. 12. 20</li> </ul> </li> </ul>	対象銘柄（略称）	国庫証券 第 900 回	銘柄コード	JP1749001H99	発行方法	16 価格競争および特別参加者第 I 非競争	入札日	29. 9. 15	発行日	29. 9. 19	償還期限	29. 12. 19	発行予定額	2 兆 8, 600 億円程度 <sup>(注)</sup>	競争入札の応募限度額	100 億円	第 I 非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額	一律 200 億円	応募価格の単位	5 毛刻み	応募額一口の金額	・価格競争入札および第 I 非競争入札…10 百万円	発行価格の決定方法	各募入価格	—	
対象銘柄（略称）	国庫証券 第 900 回																											
銘柄コード	JP1749001H99																											
発行方法	16 価格競争および特別参加者第 I 非競争																											
入札日	29. 9. 15																											
発行日	29. 9. 19																											
償還期限	29. 12. 19																											
発行予定額	2 兆 8, 600 億円程度 <sup>(注)</sup>																											
競争入札の応募限度額	100 億円																											
第 I 非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額	一律 200 億円																											
応募価格の単位	5 毛刻み																											
応募額一口の金額	・価格競争入札および第 I 非競争入札…10 百万円																											
発行価格の決定方法	各募入価格																											
10:30 ┆ 11:30	入札参加者	<p><b>【実施要項の受信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 開始時刻（10:30）直後、各入札参加者は、対象銘柄にかかる「国債入札実施要項通知」を受信します。</li> </ul> <p>—— 万一、開始時刻を数分経過しても、端末装置に「国債入札実施要項通知」が配信されない場合には、日本銀行*に連絡し、同通知のファクシミリ送信を依頼してください。</p> <p>※連絡先 042-351-1127</p>	<p>・端末装置のブザー音が連続で鳴り、日銀ネットで次の電文を受信していること。</p> <p>＜ E X 一方通知電文＞</p> <table border="1" data-bbox="1676 1659 2656 1753"> <tr> <td>帳票コード</td> <td>受信電文</td> </tr> <tr> <td>7211-00103</td> <td>国債入札実施要項通知</td> </tr> </table>	帳票コード	受信電文	7211-00103	国債入札実施要項通知	□																				
帳票コード	受信電文																											
7211-00103	国債入札実施要項通知																											

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック																					
	入札参加者	<p><b>【入札要項の送信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 本テストに参加する入札参加者は、日銀ネットで「入札要項」(721101)を送信してください。</li> <li>● 入札参加者の区分(国債市場特別参加者、それ以外の入札参加者)に応じ、次表のとおり入力してください。</li> </ul> <table border="1" data-bbox="608 457 1608 730"> <thead> <tr> <th rowspan="2"></th> <th rowspan="2">特別参加者非競争 入札分の応募額</th> <th colspan="2">価格競争入札分</th> </tr> <tr> <th>応募額の合計</th> <th>応募価格</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>国債市場 特別参加者</td> <td>200億円以下の 任意の額<sup>(注1)</sup></td> <td>100億円以下の 任意の額<sup>(注1)</sup></td> <td rowspan="2">任意の応募価格<sup>(注2)</sup></td> </tr> <tr> <td>上記以外 の入札参加者</td> <td>—</td> <td>100億円以下の 任意の額<sup>(注1)</sup></td> </tr> </tbody> </table> <p>(注1) 応募額一口の金額の整数倍を入力してください。</p> <p>(注2) 普段応札している応募価格を目安としてください。普段応札していない入札参加者におかれては、財務省のホームページで公表されている募入平均価格をご参考にしてください。</p> <p>— 詳細については、「利用細則」第2編の端末操作手順における業務処理区分「入札要項」(721101)をご参照ください。</p>		特別参加者非競争 入札分の応募額	価格競争入札分		応募額の合計	応募価格	国債市場 特別参加者	200億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	100億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	任意の応募価格 <sup>(注2)</sup>	上記以外 の入札参加者	—	100億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	<p>・日銀ネットで「入札要項」を送信後、次の電文を受信していること。</p> <p>&lt;RES電文&gt;</p> <table border="1" data-bbox="1676 367 2647 499"> <thead> <tr> <th>帳票コード</th> <th>受信電文</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Z***-*****</td> <td>共通受付済応答<sup>(注)</sup></td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 送信した業務処理区分名およびその送信処理を受付けた旨が記載されています。</p> <p>&lt;EX応答電文&gt;</p> <table border="1" data-bbox="1676 682 2647 772"> <thead> <tr> <th>帳票コード</th> <th>受信電文</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>7211-00202</td> <td>国債入札要項受信済通知</td> </tr> </tbody> </table>	帳票コード	受信電文	Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>	帳票コード	受信電文	7211-00202	国債入札要項受信済通知	<p>□</p>
	特別参加者非競争 入札分の応募額	価格競争入札分																							
		応募額の合計	応募価格																						
国債市場 特別参加者	200億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	100億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	任意の応募価格 <sup>(注2)</sup>																						
上記以外 の入札参加者	—	100億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>																							
帳票コード	受信電文																								
Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>																								
帳票コード	受信電文																								
7211-00202	国債入札要項受信済通知																								

(2-1) 利付国(10年) <価格競争、非競争および特別参加者第I非競争> (10:40~11:50) 【第1回】

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック																														
—	—	<p><b>【対象銘柄等】</b></p> <table border="1" data-bbox="602 279 1537 1161"> <tr> <td>対象銘柄(略称)</td> <td>利付国(10年) 第343回</td> </tr> <tr> <td>銘柄コード</td> <td>JP1103431G66</td> </tr> <tr> <td>発行方法</td> <td>17 価格競争、非競争および特別参加者第I非競争</td> </tr> <tr> <td>入札日</td> <td>29.9.15</td> </tr> <tr> <td>発行日</td> <td>29.9.19</td> </tr> <tr> <td>利率(年)</td> <td>0.1%</td> </tr> <tr> <td>初期利子支払期</td> <td>29.12.20</td> </tr> <tr> <td>償還期限</td> <td>38.6.20</td> </tr> <tr> <td>発行予定額</td> <td>3兆8,000億円程度<sup>(注)</sup></td> </tr> <tr> <td>競争入札の応募限度額</td> <td>1,000億円</td> </tr> <tr> <td>非競争入札の応募限度額</td> <td>10億円</td> </tr> <tr> <td>第I非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額</td> <td>一律200億円</td> </tr> <tr> <td>応募価格の単位</td> <td>1銭刻み</td> </tr> <tr> <td>応募額一口の金額</td> <td>・価格競争入札および第I非競争入札…1億円 ・非競争入札…1百万円</td> </tr> <tr> <td>発行価格の決定方法</td> <td>各募入価格</td> </tr> </table> <p>(注) 予告なく変更する可能性があります。RT 当日の「国債入札実施要項通知」でご確認願います。</p>	対象銘柄(略称)	利付国(10年) 第343回	銘柄コード	JP1103431G66	発行方法	17 価格競争、非競争および特別参加者第I非競争	入札日	29.9.15	発行日	29.9.19	利率(年)	0.1%	初期利子支払期	29.12.20	償還期限	38.6.20	発行予定額	3兆8,000億円程度 <sup>(注)</sup>	競争入札の応募限度額	1,000億円	非競争入札の応募限度額	10億円	第I非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額	一律200億円	応募価格の単位	1銭刻み	応募額一口の金額	・価格競争入札および第I非競争入札…1億円 ・非競争入札…1百万円	発行価格の決定方法	各募入価格	—	
対象銘柄(略称)	利付国(10年) 第343回																																	
銘柄コード	JP1103431G66																																	
発行方法	17 価格競争、非競争および特別参加者第I非競争																																	
入札日	29.9.15																																	
発行日	29.9.19																																	
利率(年)	0.1%																																	
初期利子支払期	29.12.20																																	
償還期限	38.6.20																																	
発行予定額	3兆8,000億円程度 <sup>(注)</sup>																																	
競争入札の応募限度額	1,000億円																																	
非競争入札の応募限度額	10億円																																	
第I非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額	一律200億円																																	
応募価格の単位	1銭刻み																																	
応募額一口の金額	・価格競争入札および第I非競争入札…1億円 ・非競争入札…1百万円																																	
発行価格の決定方法	各募入価格																																	
10:40 ┆ 11:50	入札参加者	<p><b>【実施要項の受信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 開始時刻(10:40)直後、各入札参加者は、対象銘柄にかかる「国債入札実施要項通知」を受信します。</li> </ul> <p>— 万一、開始時刻を数分経過しても、端末装置に「国債入札実施要項通知」が配信されない場合には、日本銀行<sup>*</sup>に連絡し、同通知のファクシミリ送信を依頼してください。</p> <p>※連絡先 042-351-1127</p>	<p>・端末装置のブザー音が連続で鳴り、日銀ネットで次の電文を受信していること。</p> <p>&lt;EX一方通知電文&gt;</p> <table border="1" data-bbox="1676 1524 2650 1619"> <tr> <td>帳票コード</td> <td>受信電文</td> </tr> <tr> <td>7211-00104</td> <td>国債入札実施要項通知</td> </tr> </table>	帳票コード	受信電文	7211-00104	国債入札実施要項通知	□																										
帳票コード	受信電文																																	
7211-00104	国債入札実施要項通知																																	

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック																									
	入札参加者	<p><b>【入札要項の送信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 本テストに参加する入札参加者は、日銀ネットで「入札要項」(721101)を送信してください。</li> <li>● 入札参加者の区分(国債市場特別参加者、それ以外の入札参加者)に応じ、次表のとおり入力してください。</li> </ul> <table border="1" data-bbox="608 457 1587 823"> <thead> <tr> <th rowspan="2"></th> <th rowspan="2">特別参加者 非競争入札分 の応募額</th> <th rowspan="2">非競争入札分 の応募額</th> <th colspan="2">価格競争入札分</th> </tr> <tr> <th>応募額の 合計</th> <th>応募価格</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>国債市場 特別参加者</td> <td>200億円以下の 任意の額<sup>(注1)</sup></td> <td>—</td> <td>1,000億円 以下の任意 の額<sup>(注1)</sup></td> <td>任意の 応募価格<sup>(注2)</sup></td> </tr> <tr> <td>上記以外 の入札参加者</td> <td>—</td> <td>10億円以下の 任意の額<sup>(注1)</sup></td> <td>—</td> <td>—</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注1) 応募額一口の金額の整数倍を入力してください。</p> <p>(注2) 普段応札している応募価格を目安としてください。</p> <p>— 詳細については、「利用細則」第2編の端末操作手順における業務処理区分「入札要項」(721101)をご参照ください。</p>		特別参加者 非競争入札分 の応募額	非競争入札分 の応募額	価格競争入札分		応募額の 合計	応募価格	国債市場 特別参加者	200億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	—	1,000億円 以下の任意 の額 <sup>(注1)</sup>	任意の 応募価格 <sup>(注2)</sup>	上記以外 の入札参加者	—	10億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	—	—	<p>・日銀ネットで「入札要項」を送信後、次の電文を受信していること。</p> <p>&lt;RES電文&gt;</p> <table border="1" data-bbox="1676 367 2647 464"> <thead> <tr> <th>帳票コード</th> <th>受信電文</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Z***-*****</td> <td>共通受付済応答<sup>(注)</sup></td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 送信した業務処理区分名およびその送信処理を受付けた旨が記載されている。</p> <p>&lt;EX応答電文&gt;</p> <table border="1" data-bbox="1676 646 2647 743"> <thead> <tr> <th>帳票コード</th> <th>受信電文</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>7211-00202</td> <td>国債入札要項受信済通知</td> </tr> </tbody> </table>	帳票コード	受信電文	Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>	帳票コード	受信電文	7211-00202	国債入札要項受信済通知	<p>□</p>
	特別参加者 非競争入札分 の応募額	非競争入札分 の応募額				価格競争入札分																							
			応募額の 合計	応募価格																									
国債市場 特別参加者	200億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	—	1,000億円 以下の任意 の額 <sup>(注1)</sup>	任意の 応募価格 <sup>(注2)</sup>																									
上記以外 の入札参加者	—	10億円以下の 任意の額 <sup>(注1)</sup>	—	—																									
帳票コード	受信電文																												
Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>																												
帳票コード	受信電文																												
7211-00202	国債入札要項受信済通知																												

(2-2) 利付国(10年) <特別参加者第Ⅱ非競争> (13:30~14:00) 【第1回】

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック																						
—	—	<p><b>【対象銘柄等】</b></p> <table border="1"> <tr> <td>対象銘柄(略称)</td> <td>利付国(10年) 第343回</td> </tr> <tr> <td>銘柄コード</td> <td>JP1103431G66</td> </tr> <tr> <td>発行方法</td> <td>18 特別参加者第Ⅱ非競争</td> </tr> <tr> <td>入札日</td> <td>29.9.15</td> </tr> <tr> <td>発行日</td> <td>29.9.19</td> </tr> <tr> <td>利率(年)</td> <td>0.1%</td> </tr> <tr> <td>初期利子支払期</td> <td>29.12.20</td> </tr> <tr> <td>償還期限</td> <td>38.6.20</td> </tr> <tr> <td>発行価格</td> <td>国債入札実施要項通知で通知</td> </tr> <tr> <td>第Ⅱ非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額</td> <td>一律200億円</td> </tr> <tr> <td>応募額一口の金額</td> <td>1億円</td> </tr> </table>	対象銘柄(略称)	利付国(10年) 第343回	銘柄コード	JP1103431G66	発行方法	18 特別参加者第Ⅱ非競争	入札日	29.9.15	発行日	29.9.19	利率(年)	0.1%	初期利子支払期	29.12.20	償還期限	38.6.20	発行価格	国債入札実施要項通知で通知	第Ⅱ非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額	一律200億円	応募額一口の金額	1億円	—	
対象銘柄(略称)	利付国(10年) 第343回																									
銘柄コード	JP1103431G66																									
発行方法	18 特別参加者第Ⅱ非競争																									
入札日	29.9.15																									
発行日	29.9.19																									
利率(年)	0.1%																									
初期利子支払期	29.12.20																									
償還期限	38.6.20																									
発行価格	国債入札実施要項通知で通知																									
第Ⅱ非競争入札にかかる各国債市場特別参加者の応募限度額	一律200億円																									
応募額一口の金額	1億円																									
13:30 ┌ 14:00	国債市場 特別参加者	<p><b>【実施要項の受信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 開始時刻(13:30)直後、各国債市場特別参加者は、対象銘柄にかかる「国債入札実施要項通知」を受信します。</li> </ul> <p>—— 万一、開始時刻を数分経過しても、端末装置に「国債入札実施要項通知」が配信されない場合には、日本銀行*に連絡し、同通知のファクシミリ送信を依頼してください。</p> <p>※連絡先 042-351-1127</p>	<p>・端末装置のブザー音が連続で鳴り、日銀ネットで次の電文を受信していること。</p> <p>&lt;EX一方通知電文&gt;</p> <table border="1"> <tr> <td>帳票コード</td> <td>受信電文</td> </tr> <tr> <td>7211-00105</td> <td>国債入札実施要項通知</td> </tr> </table>	帳票コード	受信電文	7211-00105	国債入札実施要項通知	<input type="checkbox"/>																		
	帳票コード	受信電文																								
7211-00105	国債入札実施要項通知																									
国債市場 特別参加者	<p><b>【入札要項の送信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 各国債市場特別参加者は、日銀ネットで「入札要項」(721101)を送信してください。</li> </ul> <p>—— 応募限度額の範囲内で任意の応募額を入力してください。</p> <p>—— 詳細については、「利用細則」第2編の端末操作手順における業務処理区分「入札要項」(721101)をご参照ください。</p>	<p>・日銀ネットで「入札要項」を送信後、次の電文を受信していること。</p> <p>&lt;RES電文&gt;</p> <table border="1"> <tr> <td>帳票コード</td> <td>受信電文</td> </tr> <tr> <td>Z***-*****</td> <td>共通受付済応答<sup>(注)</sup></td> </tr> </table> <p>(注) 送信した業務処理区分名およびその送信当該処理を受付けた旨が記載されている。</p> <p>&lt;EX応答電文&gt;</p> <table border="1"> <tr> <td>帳票コード</td> <td>受信電文</td> </tr> <tr> <td>7211-00202</td> <td>国債入札要項受信済通知</td> </tr> </table>	帳票コード	受信電文	Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>	帳票コード	受信電文	7211-00202	国債入札要項受信済通知	<input type="checkbox"/>															
帳票コード	受信電文																									
Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>																									
帳票コード	受信電文																									
7211-00202	国債入札要項受信済通知																									

(3) 特別参加者流動性供給＜利回格差競争＞ (10:40～11:50) 【第2回】

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック																						
—	—	<p><b>【対象銘柄等】</b></p> <table border="1" data-bbox="602 281 1576 1150"> <tr> <td data-bbox="602 281 937 415">対象銘柄 (略称)</td> <td data-bbox="937 281 1576 415">                     利付国 (10 年) 第 325 回～第 344 回                      利付国 (20 年) 第 58 回～第 142 回                      利付国 (30 年) 第 1 回～第 45 回                 </td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 415 937 550">銘柄コード<sup>(注1)</sup></td> <td data-bbox="937 415 1576 550">                     JP1103251C91～JP1103441G98                      JP12005812A4～JP1201421D22                      JP1300011W09～JP1300451EC6                 </td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 550 937 596">発行方法</td> <td data-bbox="937 550 1576 596">19 特別参加者流動性供給・利回格差競争</td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 596 937 642">入札日</td> <td data-bbox="937 596 1576 642">29. 9. 19</td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 642 937 688">発行日</td> <td data-bbox="937 642 1576 688">29. 9. 20</td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 688 937 735">発行予定額</td> <td data-bbox="937 688 1576 735">2 兆 5, 000 億円程度<sup>(注2)</sup></td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 735 937 781">応募限度額</td> <td data-bbox="937 735 1576 781">発行予定額の 4%<sup>(注2)</sup></td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 781 937 827">応募利回格差の単位</td> <td data-bbox="937 781 1576 827">0. 001%刻み</td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 827 937 873">応募額一口の金額</td> <td data-bbox="937 827 1576 873">1 億円</td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 873 937 919">発行価格の決定方法</td> <td data-bbox="937 873 1576 919">各募入利回により算出した価格</td> </tr> <tr> <td data-bbox="602 919 937 1150">基準利回<sup>(注3)</sup></td> <td data-bbox="937 919 1576 1150">                     銘柄毎の基準利回は、平成 29 年 9 月 19 日付                      で日本証券業協会が発表した公社債店頭売買                      参考統計値表掲載の平均値の単利利回り (同                      日午前 9 時以前に訂正の場合には、訂正後の                      当該利回り)                 </td> </tr> </table> <p data-bbox="602 1157 1626 1241">(注 1) 「国債入札実施要項通知」には対象銘柄にかかる全銘柄コードが記載                      されます。</p> <p data-bbox="602 1247 1626 1331">(注 2) 予告なく変更する可能性があります。RT 当日の「国債入札実施要項                      通知」でご確認願います。</p> <p data-bbox="602 1337 1626 1463">(注 3) 各国債市場特別参加者は、上記【対象銘柄等】に記載された情報に                      基づき、別途、日本証券業協会のホームページから当該銘柄毎の基準                      利回を取得してください。</p>	対象銘柄 (略称)	利付国 (10 年) 第 325 回～第 344 回 利付国 (20 年) 第 58 回～第 142 回 利付国 (30 年) 第 1 回～第 45 回	銘柄コード <sup>(注1)</sup>	JP1103251C91～JP1103441G98 JP12005812A4～JP1201421D22 JP1300011W09～JP1300451EC6	発行方法	19 特別参加者流動性供給・利回格差競争	入札日	29. 9. 19	発行日	29. 9. 20	発行予定額	2 兆 5, 000 億円程度 <sup>(注2)</sup>	応募限度額	発行予定額の 4% <sup>(注2)</sup>	応募利回格差の単位	0. 001%刻み	応募額一口の金額	1 億円	発行価格の決定方法	各募入利回により算出した価格	基準利回 <sup>(注3)</sup>	銘柄毎の基準利回は、平成 29 年 9 月 19 日付 で日本証券業協会が発表した公社債店頭売買 参考統計値表掲載の平均値の単利利回り (同 日午前 9 時以前に訂正の場合には、訂正後の 当該利回り)	—	
対象銘柄 (略称)	利付国 (10 年) 第 325 回～第 344 回 利付国 (20 年) 第 58 回～第 142 回 利付国 (30 年) 第 1 回～第 45 回																									
銘柄コード <sup>(注1)</sup>	JP1103251C91～JP1103441G98 JP12005812A4～JP1201421D22 JP1300011W09～JP1300451EC6																									
発行方法	19 特別参加者流動性供給・利回格差競争																									
入札日	29. 9. 19																									
発行日	29. 9. 20																									
発行予定額	2 兆 5, 000 億円程度 <sup>(注2)</sup>																									
応募限度額	発行予定額の 4% <sup>(注2)</sup>																									
応募利回格差の単位	0. 001%刻み																									
応募額一口の金額	1 億円																									
発行価格の決定方法	各募入利回により算出した価格																									
基準利回 <sup>(注3)</sup>	銘柄毎の基準利回は、平成 29 年 9 月 19 日付 で日本証券業協会が発表した公社債店頭売買 参考統計値表掲載の平均値の単利利回り (同 日午前 9 時以前に訂正の場合には、訂正後の 当該利回り)																									

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック								
10:40 ┃ 11:50	国債市場 特別参加者	<p><b>【実施要項の受信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 開始時刻（10:40）直後、各国債市場特別参加者は、対象銘柄にかかる「国債入札実施要項通知」を受信します。</li> </ul> <p>—— 万一、開始時刻を数分経過しても、端末装置に「国債入札実施要項通知」が配信されない場合には、日本銀行*に連絡し、同通知のファクシミリ送信を依頼してください。</p> <p>※連絡先 042-351-1127</p>	<p>・端末装置のブザー音が連続で鳴り、日銀ネットで次の電文を受信していること。</p> <p>&lt; E X 一方通知電文 &gt;</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>帳票コード</th> <th>受信電文</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>7211-00106</td> <td>国債入札実施要項通知</td> </tr> </tbody> </table>	帳票コード	受信電文	7211-00106	国債入札実施要項通知	<input type="checkbox"/>				
帳票コード	受信電文											
7211-00106	国債入札実施要項通知											
	国債市場 特別参加者	<p><b>【入札要項の送信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 各国債市場特別参加者は、日銀ネットで「入札要項」（721101）を送信してください。</li> </ul> <p>—— 応募額の合計が 1,000 億円以下となるよう応募額を入力してください。</p> <p>—— 応募する銘柄数は各国債市場特別参加者の実情に合せ、適宜の銘柄数とすることで差し支えありません。後続のテスト（「新規記録等」の入力）において、負荷のあるテストを希望する先におかれては、送信締切時刻（11:50）にご留意のうえ、後続のテストにおいて必要かつ十分な確認が行えるよう、応募銘柄数を通常応募するよりも多い銘柄数としてください。</p> <p>ただし、本テストでは応募した銘柄がすべて募入となる前提としておりますのでご注意ください。</p> <p>—— 詳細については、「利用細則」第2編の端末操作手順における業務処理区分「入札要項」（721101）をご参照ください。</p>	<p>・日銀ネットで「入札要項」を送信後、次の電文を受信していること。</p> <p>&lt; R E S 電文 &gt;</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>帳票コード</th> <th>受信電文</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Z***-*****</td> <td>共通受付済応答<sup>(注)</sup></td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 送信した業務処理区分名およびその送信処理を受付けた旨が記載されている。</p> <p>&lt; E X 応答電文 &gt;</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>帳票コード</th> <th>受信電文</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>7211-00201</td> <td>国債入札要項受信済通知</td> </tr> </tbody> </table>	帳票コード	受信電文	Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>	帳票コード	受信電文	7211-00201	国債入札要項受信済通知	<input type="checkbox"/>
帳票コード	受信電文											
Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>											
帳票コード	受信電文											
7211-00201	国債入札要項受信済通知											

2. 入札結果の確認（14:00以降）【第1回、第2回共通】

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック												
14:00以降	入札参加者	<p><b>【入札結果の受信】</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 各入札参加者は、上記1.（1）～（3）の「国債入札募入決定通知」を受信します。</li> </ul> <p>—— 受信時刻は、入札の種類により異なります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 各受信時刻は次のとおりです。</li> </ul> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 1.（1）国庫証券 … 14：30</li> <li>・ 1.（2－1）利付国（10年） … 14：30</li> <li>・ 1.（2－2）特別参加者第Ⅱ非競争 … 15：20</li> <li>・ 1.（3）特別参加者流動性供給 … 14：00</li> </ul> <p>—— 万一、受信時刻を数分経過しても、端末装置に「国債入札募入決定通知」が配信されない場合または募入額ゼロの旨を表示した「国債入札募入決定通知」が配信された場合には、日本銀行*に連絡してください。</p> <p>※連絡先 042-351-1127</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 発行払込の事務を払込受託者に委託している入札参加者は、適宜、当該払込受託者への連絡等を行ってください。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 端末装置のブザー音が連続で鳴り、日銀ネットで次の電文を受信していること。</li> </ul> <p>&lt; E X 一方通知電文 &gt;</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>入札区分</th> <th>帳票コード</th> <th>受信電文</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>「価格競争および特別参加者第Ⅰ非競争」、「価格競争、非競争および特別参加者第Ⅰ非競争」</td> <td>7211-00301</td> <td>国債入札募入決定通知<sup>(注)</sup></td> </tr> <tr> <td>「特別参加者第Ⅱ非競争」</td> <td>7211-00300</td> <td>国債入札募入決定通知</td> </tr> <tr> <td>「特別参加者流動性供給・利回格差競争」</td> <td>7211-00400</td> <td>国債入札募入決定通知（流動性供給）</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 帳票名については、応募した入札毎に改頁のうえ次のとおり表示されます（電文は1電文。）。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 価格競争入札…「国債入札募入決定通知（競争入札分）」</li> <li>・ 非競争入札…「国債入札募入決定通知（非競争入札分）」</li> <li>・ 特別参加者第Ⅰ非競争入札…「国債入札募入決定通知（特別参加者第Ⅰ非競争分）」</li> </ul>	入札区分	帳票コード	受信電文	「価格競争および特別参加者第Ⅰ非競争」、「価格競争、非競争および特別参加者第Ⅰ非競争」	7211-00301	国債入札募入決定通知 <sup>(注)</sup>	「特別参加者第Ⅱ非競争」	7211-00300	国債入札募入決定通知	「特別参加者流動性供給・利回格差競争」	7211-00400	国債入札募入決定通知（流動性供給）	□
入札区分	帳票コード	受信電文														
「価格競争および特別参加者第Ⅰ非競争」、「価格競争、非競争および特別参加者第Ⅰ非競争」	7211-00301	国債入札募入決定通知 <sup>(注)</sup>														
「特別参加者第Ⅱ非競争」	7211-00300	国債入札募入決定通知														
「特別参加者流動性供給・利回格差競争」	7211-00400	国債入札募入決定通知（流動性供給）														

3. 新規記録事項等の通知（14:10以降）【第1回、第2回共通】

時刻	対象	試験実施手順	確認事項	チェック								
16:30 まで	払込者	<p>【新規記録等の送信】</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 各払込者は、2. の通知受領後、「新規記録等」(721301) を送信してください。</li> </ul> <p>—— 送信可能となる時刻は、入札の種類により異なります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 各送信可能時刻は次のとおりです。</li> </ul> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 1. (1) 国庫証券 … 14:40 以降</li> <li>・ 1. (2-1) 利付国(10年) … 15:30 以降</li> <li>・ 1. (2-2) 特別参加者第Ⅱ非競争 … 15:30 以降</li> <li>・ 1. (3) 特別参加者流動性供給 … 14:10 以降</li> </ul>	<p>・ 次の電文を受信していること。</p> <p>&lt;RES電文&gt;</p> <table border="1" data-bbox="1679 369 2653 464"> <tr> <td>帳票コード</td> <td>受信電文</td> </tr> <tr> <td>Z***-*****</td> <td>共通受付済応答<sup>(注)</sup></td> </tr> </table> <p>(注) 送信した業務処理区分名およびその送信処理を受付けた旨が記載されている。</p> <p>&lt;EX応答電文&gt;</p> <table border="1" data-bbox="1679 688 2653 783"> <tr> <td>帳票コード</td> <td>受信電文</td> </tr> <tr> <td>7213-00200</td> <td>新規記録等受付通知</td> </tr> </table>	帳票コード	受信電文	Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>	帳票コード	受信電文	7213-00200	新規記録等受付通知	<input type="checkbox"/>
帳票コード	受信電文											
Z***-*****	共通受付済応答 <sup>(注)</sup>											
帳票コード	受信電文											
7213-00200	新規記録等受付通知											

以 上

2017年8月  
日本銀行

---

## 総合運転試験（RT）実施手順書

### <国債買入>

---

（実施日）2018年2月 4日（RT3-2）

（時 間）9：00～17：00

#### <事前照会先>

オファーについて

日本銀行 金融市場局 市場調節課

TEL:03-3277-1353（直通） 田中（タカ）、瀬川（セガワ）

決済について

日本銀行 業務局 総務課

TEL: 03-3277-3073（直通） 小竹（コタケ）、大脇（オオワキ）

1.	概要 .....	2
2.	参加対象先 .....	2
3.	テストデータ等 .....	3
4.	テストスケジュール等 .....	4
	(1) 日程 .....	4
	(2) 時刻の読み替え .....	5

(留意事項)

- ① 本手順書は、「国債買入」のテストで使用する手順書です。
- ② テストに係る RT 当日の実施手順につきましては、本手順書のほか、別途「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（金融調節等入札連絡事務）」および「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（国債売買等関係事務）（以下、両者を合わせて「利用細則」といいます。）」をご確認下さい。
- ③ 「国債買入」のテストにつき、不明な点がある場合には、表紙記載の「事前照会先」までご照会下さい。

## 1. 概要

- 「国債買入」のテストでは、T+1 化 RT における実効的な試験実施を支援する観点から、T+1 化実施後の国債決済環境を想定した国債買入のオファーを行います。
- 本テストにおいて実施する国債買入は、決済期間については現行比 1 営業日短縮し、T+1 としたうえで、日中のタイムスケジュールについては現行と同様の想定で行います。ただし、市場インフラの RT 用稼動時間に係る制約等に鑑み、市場取引と同様、必要な時刻の読み替えを行うことで、オファーから応募締切時刻までの時間について、一部が事実上短縮されますのでご注意ください（4.（2）参照）。
  - なお、2018 年 5 月 1 日（約定分）より実施する予定としている T+1 化実施以降の国債系オペの決済期間やタイムスケジュールについては、本テストの結果等も踏まえ、決定します。決定した内容は適宜のタイミングで日本銀行金融市場局より通知します。
- 本テストの対象は、国債買入のオファーから決済までとします。

## 2. 参加対象先

- 本テストの趣旨に鑑み、参加は任意とします（ただし、テストに参加する場合には国債買入のオファーから決済まで行って下さい）。
- ただし、日本銀行の国債買入の対象先及びその決済代行先であって、後決めレポを実施する先は、本テストへの参加が望ましいものと考えます。

### 3. テストデータ等

- 本テストでのオファー内容および買入対象国債の銘柄は、以下のとおりとします。本テストに参加する先は、本テストに伴う当預・国債残高の増減を踏まえて実施日以降のシナリオを調整して下さい。

(オファー内容)

オファー日：2017年9月19日、スタート日：2017年9月20日、予定総額：5,000億円、応募限度額：100億円、買入対象銘柄の残存期間：5年超10年以下

(買入対象銘柄)

	銘柄コード	利子支払期 (月日)	償還期日
利付国庫債券（10年） 第343回	JP1103431G66	06/20、12/20	H38.06.20
利付国庫債券（10年） 第344回	JP1103441G98	03/20、09/20	H38.09.20

(留意事項)

テスト参加先は、応募限度額の範囲内であれば、自由に応募金額を決定出来ることとします。なお、入札要項通知における銘柄ごとの基準利回りは、システム運用日付（2017/9/19付）の日証協公表の売買参考統計値を使用します。

#### 4. テストスケジュール等

##### (1) 日程

○ 本テストにおけるオファーの実施日およびシステム日付は、以下のとおりです。

	実施予定日	時間帯	システム日付
テスト日 (RT3-2)	2018年2月4日(日)	9:00~17:00	2017年9月19日
再テスト (RT3-3)	2018年2月18日(日)	9:00~17:00	2017年9月20日

##### (留意事項)

① 再テストとして国債買入のオファーを実施するケースとしては、以下を想定しています。

- ・市場取引に係るテストが順調である中で、日本銀行側のシステムトラブル等により国債買入のテストが行えなかった場合（この場合、RT3-3においてオファー日および売買参考統計値の日付を2017年9月20日、スタート日を同21日に読み替えたオファーおよびスタート決済を実施します）。
- ・市場取引に係るテストにおいて市場インフラ（証券保管振替機構、日本証券クリアリング機構、日本銀行）のシステムに問題が生じ、国債買入のテストが行えなかった場合（この場合、RT3-2のシナリオで行われる2018年2月18日(日)のテストにおいて、オファー日および売買参考統計値の日付を2017年9月19日、スタート日を同20日とするオファーおよびスタート決済（日付の読み替え不要）を実施します）。

② 市場取引について予備日が使用される場合等、システム日付が当初予定から変更となる場合については、国債買入のテストに係るシステム日付についても、市場取引における取扱いと同様に変更することとします。

## (2) 時刻の読み替え

- 市場取引と同様、市場インフラの RT 用稼動時間に係る制約等に鑑み、以下のとおり時刻の読み替えを行った上で実施することとします。

実時刻 (RT 日の時刻)	オファー日 (2018 年 2 月 4 日)	スタート日 (2018 年 2 月 18 日)	想定時刻 (本来のタイムスケジュール)
10:20	オファー	—	10:10
11:40	応募締切		11:40
12:00 頃	オファーバック		12:00 頃
14:15	—	スタート決済締切	15:00

### (留意事項)

本テストにおける入力内容、入力手順、端末操作手順については利用細則をご確認下さい。

以 上

---

総合運転試験（RT）実施手順書  
＜国債補完供給＞

---

（実施日）2018年2月18日（RT3-3）

（時間）9：00～17：00

＜事前照会先＞

オファーについて

日本銀行 金融市場局 市場調節課

TEL：03-3277-1353（直通） 田中（タカ）、瀬川（セガワ）

決済について

日本銀行 業務局 総務課

TEL：03-3277-3073（直通） 小竹（コタケ）、大脇（オオワキ）

1.	概要	2
2.	参加対象先	2
3.	テストデータ等	3
4.	テストスケジュール等	4
(1)	日程	4
(2)	時刻の読み替え	5

(留意事項)

- ① 本手順書は、「国債補完供給」のテストで使用する手順書です。
- ② テストに係る RT 当日の実施手順につきましては、本手順書のほか、別途「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（金融調節等入札連絡事務）」および「日本銀行金融ネットワークシステム利用細則（国債売買等関係事務）」（以下、両者を合わせて「利用細則」といいます。）をご確認下さい。
- ③ 「国債補完供給」のテストにつき、不明な点がある場合には、表紙記載の「事前照会先」までご照会下さい。

## 1. 概要

- 「国債補完供給」のテストでは、T+1 化 RT における実効的な試験実施を支援する観点から、T+1 化実施後の国債決済環境を想定した国債補完供給のオファーを行います。
- 本テストにおいて実施する国債補完供給は、日中のタイムスケジュールについては現行と同様の想定で行います。ただし、市場インフラの RT 用稼動時間に係る制約等に鑑み、市場取引と同様、必要な時刻の読み替えを行うことで、オファーから応募締切時刻までの時間について、一部が事実上短縮されますのでご注意ください（4.（2）参照）。
  - なお、2018 年 5 月 1 日（約定分）より実施する予定としている T+1 化実施以降の国債系オペの決済期間やタイムスケジュールについては、本テストの結果等も踏まえ、決定します。決定した内容は適宜のタイミングで日本銀行金融市場局より通知します。
- 本テストの対象は、国債補完供給のオファーからスタート決済までとします。

## 2. 参加対象先

- 本テストの趣旨に鑑み、参加は任意とします（ただし、テストに参加する場合には国債補完供給のオファーからスタート決済まで行って下さい）。
- ただし、国債補完供給の対象先及びその決済代行先であって、後決めレポを実施する先は、本テストへの参加が望ましいものと考えます。

### 3. テストデータ等

- 本テストでのオファー内容および売却対象国債の銘柄・応募限度額は、以下のとおりとします（午前・午後とも、同一の内容でオファーを行います）。本テストに参加する先は、本テストに伴う当預・国債残高の増減を踏まえて実施日以降のシナリオを調整して下さい。

(オファー内容)

オファー日（＝スタート日）：2017年9月20日、エンド日：2017年9月21日、予定総額：20,000億円、  
応募限度額：400億円、上限期間利回り：▲0.60%、応札可能期間利回数：1銘柄当り1レート

(売却対象銘柄)

	銘柄コード	売却上限額	応募限度額	利子支払期 (月日)	償還期日
利付国庫債券（10年） 第334回	JP1103341E67	5,000億円	100億円	06/20、12/20	H36.06.20
利付国庫債券（10年） 第343回	JP1103431G66	5,000億円	100億円	06/20、12/20	H38.06.20
利付国庫債券（5年） 第126回	JP1051261FC7	5,000億円	100億円	06/20、12/20	H32.12.20
利付国庫債券（2年） 第360回	JP1023601G11	5,000億円	100億円	01/15、07/15	H30.01.15

(留意事項)

- ① 本テストにおいては、「日銀国債売現先（国債補完供給）入札実施希望通知」のファクシミリ送信を行わないでください。
- ② テスト参加先は、応募限度額の範囲内であれば、自由に応募金額を決定出来ることとします。なお、売買価格の計算に用いる国債銘柄別利回りについては、システム運用日付（2017/9/20付）の日証協公表の売買参考統計値を使用します。

#### 4. テストスケジュール等

##### (1) 日程

- 本テストにおけるオファーの実施日およびシステム日付等は、以下のとおりです。

	実施予定日	時間帯	システム日付
テスト日 (RT3-3)	2018年2月18日(日)	9:00~17:00	2017年9月20日
再テスト (RT3-4)	2018年3月4日(日)	9:00~17:00	2017年9月21日

##### (留意事項)

- ① 再テストとして国債補完供給のオファーおよびスタート決済を実施するケースとしては、以下を想定しています。
- ・市場取引に係るテストが順調である中で、日本銀行側のシステムトラブル等により国債補完供給のテストが行えなかった場合（この場合、RT3-4においてオファー日および売買参考統計値の日付を2017年9月21日、エンド日を同22日に読み替えたオファーおよびスタート決済を実施します。「実施手順書<共通編>」2.(3)に定める「予備日」を使用しないため、エンド決済を行うことはできません）。
  - ・市場取引に係るテストにおいて市場インフラ（証券保管振替機構、日本証券クリアリング機構、日本銀行）のシステムに問題が生じ、国債補完供給のテストが行えなかった場合（この場合、RT3-3のシナリオで行われる2018年3月4日(日)のテストにおいて、オファー日および売買参考統計値の日付を2017年9月20日、エンド日を同21日（日付の読み替え不要）とするオファーおよびスタート決済を実施します。「実施手順書<共通編>」2.(3)に定める「予備日」を使用しますので、エンド決済を行うことが可能です）。
- ② 市場取引について予備日が使用される場合等、システム日付が当初予定から変更となる場合については、国債補完供給のテストに係るシステム日付についても、市場取引における取扱いと同様に変更することとします。

## (2) 時刻の読み替え

- 市場取引と同様、市場インフラの RT 用稼動時間に係る制約等に鑑み、以下のとおり時刻の読み替えを行った上でテストを実施することとします。

	実時刻 (RT 日の時刻)	国債補完供給 (午前)	国債補完供給 (午後)	想定時刻 (本来のタイムスケジュール)
オファー日 (スタート日)	11:50	オファー		11:50
	12:10	応募締切		12:15
	12:20 頃	オファーバック		12:30 頃
	12:45	スタート決済締切		13:15
	13:20		オファー	13:50
	13:45		応募締切	14:15
	14:00 頃		オファーバック	14:30 頃
	14:30		スタート決済締切*	15:30
	15:15	「国債条件付売買期日決済案内」の受信		17:00
エンド日	14:15	エンド決済締切		15:00

※ 翌営業日を元利払日とする銘柄を使用したテストの実施はありません。

### (留意事項)

- ① 本テストにおける入力内容、入力手順、端末操作手順については利用細則をご確認下さい。
- ② RT3-3 でのスタート決済が完了した個別契約については、RT3-4 の業務開始時、エンド決済にかかる「国債資金同時受渡依頼受付案内」が出力されますが、これに対応する「決済指示 (国債)」の送信は任意とします。エンド決済を行わない場合、当該国債はテスト参加先の手許に残存し、特段のエラー等は生じません。

以 上





想定時刻（市場取引・日銀オペ）		7:00	8:00	9:00	10:00	11:00	12:00	13:00	14:00	15:00	16:00	17:00	18:00	19:00	20:00	21:00	22:00	備考
RT日実時刻		8:30	9:12	9:35	10:00	10:40	11:30	12:20	13:00	14:00	14:30	15:10	15:45	16:00	16:24	16:48	17:20	
		9:00	9:25	9:50	10:10	11:00	12:00	12:30	13:30	14:15	15:00	15:15	15:52	16:12	16:36	17:00		
共通																		
リスク管理																		
変動証拠金／受渡調整金																		変動証拠金／受渡調整金
当初証拠金所要額算出			当初証拠金 1回目分				当初証拠金 2回目分			当初証拠金 3回目分								当初証拠金通知（1回目、2回目、3回目）
清算基金／破綻時証拠金所要額算出																		・清算基金通知 ・破綻時証拠金は破綻発生時のみ
FOS決済																		
FOS決済予定算出																		FOS決済予定通知
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。
当初証拠金決済																		
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。
清算基金決済																		
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。
破綻時証拠金決済																		
差入					差入													破綻発生時のみ
終了通知			1回目				2回目			3回目		4回目			5回目			終了通知

想定時刻（市場取引・日銀オペ）		7:00	8:00	9:00	10:00	11:00	12:00	13:00	14:00	15:00	16:00	17:00	18:00	19:00	20:00	21:00	22:00	備考			
RT日実時刻		8:30	9:12	9:35	10:00	10:40	11:30	12:20	13:00	14:00	14:30	15:10	15:45	16:00	16:24	16:48	17:20				
		9:00	9:25	9:50	10:10	11:00	12:00	12:30	13:30	14:15	15:00	15:15	15:52	16:12	16:36	17:00					
日銀	日銀ネット																				
	日銀ネットCPU接続可能時間帯			日銀ネットCPU接続可能時間帯															RTフェーズ3におけるCPU接続可能時間帯であり、通常時とは異なりますので、ご注意ください。		
	日銀ネット当預・国債決済可能時間帯			日銀ネット当預・国債決済可能時間帯																	
	日銀ネットコアタイム			[コアタイム]																	
	JSCC接続時間帯			JSCC接続時間(国債/当預)																	
保振	決済照合システム																				
	決済照合システム接続可能時間帯			約定照合業務時間															照合一致かつJSCC対象取引をJSCCへ送信、JSCCからの通知を参加者に送信		
	JSCC受信			約定照合業務時間																	
JSCC送信			決済照合業務時間																		