

資料 3

第2回・総合運転試験（9月7日）におけるデータの取扱いについて

次期短資取引約定確認システム（以後、「約定確認システム」という）の第2回・総合運転試験では、原則として、次世代RTGS「フェーズⅡ」（第3回）の試験で用いる「想定日（6月30日）の実データ」を用い、当該データの取扱方法については、下記のとおりとします。

記

- ①コール取引は、想定日の「当日物」のみとし、かつ当日スタートの「ターム物」はオーバーナイト物に読み替える。
- ②約定確認システムへのデータ入力は、原則として実データの入力時刻に合わせ実行するが、想定日の決済時刻繰り上げ対象のデータについては以下の扱いとする。

▽決済時刻の読替方法と約定データの入力時刻について

決済時刻の読替方法		約定データの入力時刻	
想定日の決済時刻	テスト日の決済時刻	想定日の約定時刻	テスト日の約定データ入力時刻
9：00～14：30	9：00～14：30 (読み替えなし)	(原則) 8:30*～13:30 (入力時刻は決済時刻の 1時間前) <small>*約定確認システムの入力開始時間</small>	(原則)「想定日に実データを入力した時刻」 —— ただし、13:30～14：30 に入力されたものは 「13:30」
14：30～16：30	一律「14：30」	(原則) 13:30～15:30 (入力時刻は決済時刻の 1時間前)	(原則) 一律に「13:30」 —— ただし、想定日において、13:30 以前に約定され、 入力されていたデータについては、「想定日 に実データを入力した時刻」
16：30～18：00	一律「2時間繰上げ」	(原則) 15:30～18:00 (入力時刻は決済時刻の 1時間前)	(原則) 一律に「読替えた決済時刻の1時間前」 (13:30～15:00) —— ただし、想定日において、13:30 以前に約定され、 入力されていたデータについては、「想定日 に実データを入力した時刻」

以上