

相対ネットィング照合等の実務に関する取扱指針

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 24 年 4 月実施のガイドラインにおいては、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の様式（以下「照合通知データフォー

(注1) 証券会社（金融商品取引法に規定する金融商品取引業者）や銀行等におけるリテール向けの国債取引（国債の窓口販売を含む）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、事務フローが市場参加者により区々となっているため、本取扱指針を参考にしつつ、受託者と委託者との間で個別に事務フローの見直し等を図ることが考えられる。

マット」という。)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。

なお、(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ない^(注2)。

② 異額面のペイメント・ネットィング

平成24年4月実施のガイドラインにおいては、異額面のペイメント・ネットィングを「標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング」として位置付けるとともに、①の相対ネットィング照合事務の電子化等と同様に、短時間で相対ネットィ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・ネットィングの実施は、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、(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・ネットィ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・ネットィ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

- | |
|-----------------------------------|
| ○ 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。 |
|-----------------------------------|

(記事欄)

- ・データ項目中の「記事欄」は、ガイドラインII.4.(3)を参照しつつ、決済の依頼者を特定するための情報を記入する。

^(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3参照)を送付することが想定される。

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、日銀ネット上の「金融機関等コード」4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。

(例) 0975028920120423_001.csv

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に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・ネットィング

ガイドラインに定める「標準的なネットィング・スキームに準じたネットィング」として、異額面のペイメント・ネット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・ネットィング

^(注3) Web サービスに求める機能等については、別紙4参照。

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

照合通知データフォーマット(項目定義書)

【CSV形式】

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	ネットティング後の合計は「1」 ネットティング元の明細は「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合対象外項目。)
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合対象外項目。)
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合対象外項目。)
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合対象外項目。)
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ティ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	—	英数字+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	—	x---x	ISINコード(12桁)	◎	JP11029718C3	
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。ネットティング後の合計データにおいては照合対象外項目。)
19	(記事(国債払出先関係者1))BIC	11	英数字	—	x---x	BICコード左詰め 非居住者(BICコードを利用しない等の非居住者を除く。)の場合設定	▲	DDDDDEFF	
20	(記事(国債払出先関係者1))BIC以外	35	数字	—	9---9	金融機関の場合は4桁の統一金融機関番号、証券会社は4桁の証券会社等標準コードを左詰で設定 非居住者の場合においてBICコードを利用しない等の場合は「保振統一ファンドコード」を左詰で設定 信託勘定等の場合は「ファンド番号」を左詰で設定	▲	1234	
21	(記事(国債払出先関係者1))コード設定主体	35	英数字	—	x---x	統一金融機関番号の場合は「BA」、証券会社等標準コードの場合は「SC」を設定 非居住者の場合においてBICコードを利用しない等の場合は「NR」を設定 信託勘定等の場合は「FN」を設定	▲	BA	
22	(記事(国債払出先関係者1))口座情報	35	英数字カナ	—	x---x	当事者間で合意した内容を記入	▲	5000000001	
23	(記事(国債受入先関係者1))BIC	11	英数字	—	x---x	BICコード左詰め 非居住者(BICコードを利用しない等の非居住者を除く。)の場合設定	▲	DDDDDEFF	
24	(記事(国債受入先関係者1))BIC以外	35	数字	—	9---9	金融機関の場合は4桁の統一金融機関番号、証券会社は4桁の証券会社等標準コードを左詰で設定 非居住者の場合においてBICコードを利用しない等の場合は「保振統一ファンドコード」を左詰で設定 信託勘定等の場合は「ファンド番号」を左詰で設定	▲	1234	
25	(記事(国債受入先関係者1))コード設定主体	35	英数字	—	x---x	統一金融機関番号の場合は「BA」、証券会社等標準コードの場合は「SC」を設定 非居住者の場合においてBICコードを利用しない等の場合は「NR」を設定 信託勘定等の場合は「FN」を設定	▲	FN	
26	(記事(国債受入先関係者1))口座情報	35	英数字カナ	—	x---x	当事者間で合意した内容を記入	▲	5000000001	
27	メッセージ欄	—	英数字カナ	—	x---x	メッセージ記入欄	▲	ツイカヤクジョウブン	
28	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	
29	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	
30	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内容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。

照合通知データ(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リ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ITGを使用)

A選L受付けの取引				B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					

決済当事者A→決済当事者Bへ送付するネットリ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	資金決済金額	国債決済金額	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	12340001	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へ送付するネットリ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	資金決済金額	国債決済金額	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	4100000000	4000000000	ABCDEFGHI5000000001										

照合通知データ作成に係る留意点

Q 1 : 「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。」との記載がありますが、どちらが望ましいか教えてください。

A : Excel 形式では、取引の当事者間において、セルレベルでフォーマットの統一や Rounding (丸め処理) 等のルール決めが煩雑になります。また、各社システムにおける互換性を踏まえると、CSV 形式を標準として使用することが望ましいと考えられます。

Q 2 : ファイル名称における「枝番」は任意とのことですが、どのような数値を付しても問題ないとの認識でよいでしょうか。

A : 「枝番」がユニークであることを前提に、そのような理解で問題ないと考えます。
なお、古いファイルから新しいファイルにかけて昇順で枝番を付す場合には、取引の当事者において照合通知データの受信を認識しやすいと考えます。

Q 3 : 照合通知データを電子的に授受する場合に、情報セキュリティの確保は重要ですが、Web サービス利用の場合はシステムの情報セキュリティが確保されており、ファイルにパスワードを設定する必要はないという理解でよいでしょうか。

A : その理解で問題ありません。Web サービスを利用する場合には、照合通知データ (圧縮した CSV 形式のファイルを含む。) にパスワードを設定する必要はありません。なお、メールによる授受の場合は、ファイルにパスワードを付与することが標準の取扱いです。

取扱指針 2. ④「セキュリティ」参照

Q 4 : 照合通知データの授受に電子メールを利用する場合には、パスワードはどのように設定すればよいでしょうか。

A : 取引の当事者間で取り決める内容と考えますが、送信者側においてパスワードを設定することを想定しています。なお、取引の当事者間ごとにこのような取決めを

行うことは非常に煩雑な作業になると考えられることから、多くの市場参加者が Web サービスを利用することが望まれます。

Q 5 : 信託銀行へ照合通知データを送信する場合に、同信託銀行が決済を行っているファンドごとに同データを分割して送信する必要がありますか。

A : 信託銀行が決済を行っている全てのファンドの照合通知データを、まとめて1つのファイルで送信することを想定しています。したがって、ファンドごとに同データを分割して送信する必要はありません。

Q 6 : 照合通知データを GSV 形式で作成する場合には、文字列を「" "」でくくる必要はありますか。

A : 文字列を含め全ての項目を「" "」でくくることを推奨します。なお、Excel 形式で作成した照合通知データを GSV 形式により保存し直した場合には、文字列が「" "」でくくられなくなることに御留意ください。

Q 7 : 数値を記入する照合通知データの項目について、その項目の先頭の数値がゼロの場合には、どのように送信するのでしょうか。

A : 「" "」でくくることを推奨します。

Q 8 : 「桁数」欄が「-」となっている項目は、最大桁数の制限はないとの理解でよいでしょうか。

A : 特段の制限はありませんが、通常実務の範囲内の桁数と考えます。

Q 9 : 「SEQ」はユニークであれば飛び番号を使用することは可能ですか。

A : そのような理解で問題ないと考えます。

Q10 : 「明細・合計区分」を設定する場合に留意する点は何ですか。

A : 「合計」行を先に設定し、次に同「合計」の内訳として「明細」行を設定してください。なお、「合計」行の次に異なる取引の「明細」行が混在しないよう御留意ください。

Q11 : 「保有形態」は、必要な項目でしょうか。

A : 「保有形態」は、事実上、振替債しか存在しない現在では入力不要と思われますが、将来的に新しい管理形態が採用された場合は、円滑な移行が可能となるよう任意項目として設定しています。

Q12 : 「信託銀行ファンドNO」は、決済照合システムで使用している統一ファンドコードのうち、取引の当事者が付番する個別のファンドコード（最大 19 桁）を設定することでよいでしょうか。

A : そのような理解で問題ないと考えます。

Q13 : 「銘柄名称」等は「カナ漢字」の設定が可能ですが、文字コードを決める必要はないでしょうか。

A : 文字コードは、SJIS を標準といたします。

※ SJIS コード : 日本語文字コードの一つ。Microsoft 社によって策定された。文字の 1 バイト目を見るだけで漢字か半角英数字か分かる等の特長から、パソコンの標準文字コードとして広く普及した。

Q14 : 「銘柄名称」は合致項目ではないため、取引の当事者ごとで管理している発行会社名のデータが異なる場合でも問題はないでしょうか。

A : その理解で問題ありません。

Q15:「銘柄名称」等は「カナ漢字」の設定が可能です。一般的に漢字で記載している文字も全てカナ文字で設定しても問題はないでしょうか。

A: その理解で問題ありません。

Q16:「銘柄名称」等において、漢字以外は全て半角で設定しても問題ないでしょうか。

A: 半角と全角が混在した場合でも問題はありません。

Q17:「メッセージ欄」と「備考欄」について、想定されているセット内容の具体例を教えてください。

A: 例えば、「メッセージ欄」は、追加・修正等を行うために照合通知データを再度、取引相手方に送信する場合の注記として利用できます。また、「備考欄」につきましては、「作成者が必要とする事項について記入」することとしており、自己（作成者）口座における取引である旨を記入することに利用できます。

Q18:「メッセージ欄」を常時空白に設定することは問題ないでしょうか。

A: その理解で問題ありません。

Q19: WI 取引については、当初約定時と銘柄確定時の2回とも照合通知データを送信する必要があるのでしょうか。また、「メッセージ欄」は当初約定時と銘柄確定時において、どのように設定すればよいでしょうか。

A: 当初約定時に照合通知データを送信し、入札実施が確認された時点で、改めて銘柄、単価等を追加設定した照合通知データを送信することを想定しています。
なお、「メッセージ欄」の設定については、特段のルールはございません。

以 上

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ting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. ニ当事者間におけるネットting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ting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ting明細			原約定明細					
ネットting 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 サービスに求める機能等

- 以下の項目は、照合通知データの電子的な授受の方法として、市場参加者がWebサービスの利用を検討する際に、効率的にWebサービスの利用の判断が出来るように、同サービスに求める機能やサービス提供事業者との間で確認すべき事項について整理したものである。

◎は必須機能、○は標準サービスが望ましい機能、●は確認事項

項目	機能・確認事項
(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）^(注)。 （注）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、フォルダーの参照権限はだれが管理設定するか（新規、変更等）^(注)。 （注）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、フォルダー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）。
(2) 情報セキュリティの確保	<ul style="list-style-type: none"> ◎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）。 ○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こと（FISC 等）。
(3) 運営サポート体制	<ul style="list-style-type: none"> ◎当初、利用開始時の画面設定、参照権限設定等のサポートが適切に行われること。 ●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） ◎照会（ID 付与者）に対するカスタマーサポートが適切に行われること。 ●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。
(4) 運営サポート体制（続き）	<ul style="list-style-type: none"> ◎日本語による照会対応が、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。

	<ul style="list-style-type: none"> ● 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>○海外を含む複数オフィス・拠点の利用可能なこと。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● サポート時間帯とサポート言語（日本語、英語）。 ● ユーザーマニュアルは英語、日本語が利用可能か。
(5) 提供機能	<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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 送信者が画面で確認できるか。 <p>○フォルダーへのファイルアップロード機能。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● オプション利用の場合の追加利用料等。
(6) 障害対応	<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。</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。
(7) 利用コスト試算	<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）^(注)。 <p>(注) 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>
(8) その他	<p>◎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。</p>

以 上