



(別冊) TMIユーザー向けテストのご案内

Tokyo Market Information(TMI)
サンプルファイル提供及び接続テスト等について
－ 株式等の決済期間短縮化(T+2) －

2018年10月

株式会社 東京証券取引所

(1) 本資料の目的

株式等の決済期間短縮化(T+2)対応(2019年7月16日稼働予定)に伴い、TMIシステムから提供するファイルが一部変更になります。ユーザーにおかれまして、円滑な移行作業が進められますように、稼働前にテストの機会をご提供いたします。本紙では、オフラインでのサンプルファイル提供及びオンラインでの接続テストについてご案内いたします。

(2) オフラインでのサンプルファイル提供

ご希望のユーザー様に以下のとおりオフライン（メール）にてサンプルファイルをご提供いたします。

#	サンプルファイル内容	対象ファイル	ファイル内容の概要
①	新フォーマットのレイアウト確認用ファイル	<ul style="list-style-type: none"> 銘柄別決済処理明細(予定) 	<ul style="list-style-type: none"> ご提供ファイルはテスト値であり、他ファイル等とのデータ整合性はありません。 業務日付はテスト用の値として、「2018年12月3日」を設定します。
②	清算システム休日参加者テスト結果ファイル	<ul style="list-style-type: none"> 銘柄別決済処理明細(予定) 銘柄別決済処理明細(確定) 売買受渡明細 総括清算表(決済代金・値洗差金) 総受払代金計算表(確定額) フェイル情報通知(受渡後) 貸借引受明細 D V P 清算値段 	<ul style="list-style-type: none"> 清算システムの休日参加者テスト(清算システム本番環境)において作成されたファイルをテスト後にご提供します。
③	T+2化に向けた休日参加者テストの事前準備用DVP清算値段ファイル	<ul style="list-style-type: none"> D V P 清算値段 	<ul style="list-style-type: none"> T+2化に向けた休日参加者テストに際し、貸株取引のテスト等を実施するユーザーを想定して提供する事前準備用ファイルです。 過去の本番業務におけるD V P 清算値段をベースとして、特定銘柄においてダミーの株式分割調整値段等に修正したファイルをご提供します。(詳細は5、6ページ参照)

(3) オンラインでの接続テスト

ユーザー様に実施いただくTMIシステムのオンラインでの接続テストの概要は以下のとおりです。

#	接続テスト	対象ファイル	テスト内容の概要
①	TMIシステムへの接続テスト	<ul style="list-style-type: none"> 銘柄別決済処理明細(予定) 	<p>・2019年1月・2月実施の清算システム休日参加者テスト（RT1、Day1～Day3）の日において、「銘柄別決済処理明細（予定）」ファイルをご利用いただいているユーザー様で同テストのご希望をいただいた皆様に対し、2018年12月実施の清算システム休日参加者テスト（業務確認テスト）の過程で組成した新フォーマットの「銘柄別決済処理明細（予定）」ファイルをご提供いたします。（そのため、RT 1 において清算システムから出力するファイルとは内容が異なりますのでご注意ください。） ※日程の詳細は次スライドをご参照ください</p> <p>※1 テスト当日はTMI本番環境においてテストの直前営業日に配信している通常提供ファイルに加え、新フォーマットの「銘柄別決済処理明細(予定)」が提供されます。（すなわち、「銘柄別決済処理明細(予定)」については、現行フォーマットでの本番データファイルと、新フォーマットでのテスト用ファイルの2ファイルが提供されます）</p> <p>※2 提供可能時間や新ファイル名等の詳細は年末までを目途に追ってご連絡させていただきます。</p>

(4) 各テスト日程について

#	テスト内容	サンプルファイル内容	収録内容	提供時期 (予定)
(2)-①	サンプル ファイル	新フォーマットのレイアウト確認用 ファイル	●2018年12月3日付のテストデータ	2018年12月中旬頃
(2)-②		清算システム休日参加者 テスト結果ファイル (※1)	●2018年12月 9(日) 実施分 ●2018年12月16(日) 実施分 ●2018年12月23(日) 実施分	2019年1月上旬頃
			●2019年 1月13(日) 実施分	2019年1月18日(金)頃
			●2019年 1月27(日) 実施分	2019年2月1日(金)頃
(2)-③	T+2化に向けた休日参加者テ ストの事前準備用DVP清算値 段ファイル	P5、6の①～④をご参照ください		●2019年 2月10(日) 実施 2019年2月15日(金)頃

#	テスト内容	接続テスト	TMIテスト実施日	新ファイルの収録内容
(3)-①	接続テスト	TMIシステムへの接続確認	●2019年 1月13(日)	2018年12月 9(日) テスト実績ファイル (※2)
			●2019年 1月27(日)	2018年12月16(日)テスト実績ファイル (※2)
			●2019年 2月10(日)	2018年12月23(日)テスト実績ファイル (※2)

(※1) 清算システム休日参加者テスト実績データから作成するファイルです。上記ご提供日を目途にユーザー様には個別にメールでご提供します。
上記以外のファイルをご要望のユーザー様におかれましては個別にご相談ください。

(※2) 新レイアウト・ファイル名になる「銘柄別決済処理明細(予定)」ファイルが対象です。該当日付で実施の清算システム休日参加者テストの内容を収録します。(他ファイルは各ユーザー様のご契約内容に準じ、前営業日の本番提供ファイルを格納しております。)

(5) 清算システム休日参加者テスト事前準備用のDVP清算値段ファイルについて

【株式等の決済期間短縮化 (T+2化)】休日テスト (業務確認テスト/総合運転試験 (RT)) に関する手順書<個別編 (カスタマーサイド (CS)) >の、23ページからの「**【別紙】一般振替DVPにおいて使用する時価について**」をあわせてご参照ください。

- ① 業務確認テスト (サイクル1) に対応する事前準備用のDVP清算値段ファイルとして、下記のファイルを12月3日 (月) に提供いたします。

DVP清算値段ファイル (サイクル1)

2018/11/13 終値	2018/11/14 終値
------------------	------------------

- ② RT1 (サイクル2) に対応する事前準備用のDVP清算値段ファイルとして、下記のファイルを2019年1月7日 (月) に提供いたします。

※なお、RT1 (サイクル2) では、下記のとおり一部銘柄において株式分割等のダミーのコーポレートアクション (CA) を想定した価格・レコード設定を行います。

DVP清算値段ファイル (サイクル2)							
CA想定銘柄以外		2018/12/18 終値	2018/12/19 終値	2018/12/20 終値	2018/12/21 終値	2018/12/25 終値	2018/12/26 終値
CA想定銘柄	99900	1000	1010	1020	1030	51	52
	99910	100	105	110	115	2300	2200
	99920	500	510	520	530	1590	1550
	99930	2000	2010	2020	2030	1690	1700
	99940	200	210	210	210	-	-
	99950	-	-	-	1	20	24
	99960	800	820	820	820	-	-
	99970	40	41	42	43	44	44

(5) 清算システム休日参加者テスト事前準備用のDVP清算値段ファイルについて

- ③ RT2 (サイクル3) に対応する事前準備用のDVP清算値段ファイルとして、下記のファイルを2019年2月25日(月)に提供いたします。
 ※なお、RT2 (サイクル3) では、下記のとおり一部銘柄において株式分割等のダミーのコーポレートアクション (CA) を想定した価格・レコード設定を行います。

DVP清算値段ファイル (サイクル3)						
CA想定銘柄以外		2019/2/5 終値	2019/2/6 終値	2019/2/7 終値	2019/2/8 終値	2019/2/12 終値
CA想定銘柄	99900	1010	1020	1030	51	52
	99910	105	110	115	2300	2200
	99920	510	520	530	1590	1550
	99930	2010	2020	2030	1690	1700
	99940	210	210	210	-	-
	99950	-	-	1	20	24
	99960	820	820	820	-	-
	99970	41	42	43	44	44

(注) 上記②及び③において、「-」は、銘柄が存在していない状態 (効力発生日以降の消滅銘柄、効力発生日前日までの新設銘柄) を示しています。ただし、テスト環境では1サイクル内での銘柄の増減を行わないため、当該ケースにおいて、貸株取引に係る決済金額の算出等で使用する時価については、便宜的に「1」とします (= 当該ファイルでは「1」が入ります)。

- ④ RT3 (サイクル4) に対応する事前準備用のDVP清算値段ファイルとして、下記のファイルを2019年5月20日(月)に提供いたします。

DVP清算値段ファイル (サイクル4)	
2019/4/23 終値	2019/4/24 終値

(6) 申込み及び問い合わせ

各種ファイルの取得及び接続確認テストへのご参加のご希望については、以下をご参照の上、
 (株)日本証券クリアリング機構 取引所取引清算グループ jssc-t2@jpx.co.jp 宛にご依頼ください。

#	サンプルファイル月接続テスト	申込締切日	申込方法
(2)-①	新フォーマットのレイアウト確認用ファイル	随時受付	別紙1「ファイル提供申込書・JSCC」を メール添付でご送付ください
(2)-②	清算システム休日参加者テスト結果ファイル		
(2)-③	T+2化に向けた休日参加者の事前準備用DVP清算値段ファイル	2018年11月30日(金)	
(3)-①	TMIシステムへの接続確認	2018年12月28日(金)	