

## 外国為替円決済交換高

### 1. 概要

一般社団法人全国銀行協会パブリック・リレーション部は、毎年、当協会外国為替円決済制度管理室が集計した「外国為替円決済交換高」を公表している。

公表資料	外国為替円決済交換高
公表方法	全銀協ウェブサイトに掲載
掲載されている統計資料	「決済統計年報」(毎年3月下旬)

外国為替円決済制度とは、外国為替市場における売買に伴う円代金の支払いやコルレス勘定の振替、円建仕向送金等の外国為替取引に伴う銀行間の円資金の決済を集中的に行う制度である。

この制度は、1980年10月に社団法人東京銀行協会（現在は一般社団法人全国銀行協会）の運営により発足した。発足当初は、支払指図書との交換を立会交換方式で実施し、算出された交換円は日本銀行にある当座勘定の振替により決済していたが、1989年3月からは支払指図書の交換および決済についての事務を日本銀行に委託し、日銀ネットを利用してオンライン処理を行っている。

また、1998年12月から決済リスク削減策を、国際基準であるB I Sのランファルシー基準〔注1〕に合致させる制度に移行した。これに伴い、従前の「ネット決済」のほか、日本銀行の当座勘定振替と連動する形で、外為円決済に係る支払指図1本ごとに直ちに決済する即時処理モード（「グロス決済」）を新設した。

2002年2月から、加盟銀行の複数同時破綻に対応するためリスク管理策を段階的に強化し、2004年3月には仕向超過限度額上位2行の同時破綻への対応を達成した（「ランファルシー+」基準充足）。

また、2002年5月に、C L S銀行（外貨売買に伴う時差リスク解消のための特別目的銀行）が参加し、同年9月からC L S決済（多通貨同時決済）が本格稼働して、世界的なレベルでの決済リスク（時差リスク）削減を図った。

さらに、2008年10月からは日銀当座預金決済の次世代R T G Sが稼働したことに伴い、「ネット決済」が廃止されるとともに、「同時決済」（流動性節約型のR T G S〔注2〕）が導入され、従前の「グロス決済」は「通常決済」に名称変更された。

〔注1〕1990年11月「G-10 諸国中央銀行によるインターバンク・ネットィング・スキーム検討委員会報告書」（通称「ランファルシー報告書」）の中で、ネットィングを用いるクロス・ボーダー決済システムの設計や運営に関し、リスク管理の観点から保持されるべき最低基準としてまとめられたもの。

〔注2〕決済資金に足る支払指図の組合せ（2者間、全参加者間）を探索し、複数の支払指図を同時決済することにより、従来型のRTGSに比べ流動性節約につながるとともに、時点ネット決済に内在していたシステミック・リスクが削減される。

## 2. 用語の解説

### (1) 参加銀行

日銀ネットを利用して直接支払指図を交換し、交換した支払指図に係る資金決済事務を行う「加盟銀行」のほか、支払指図の交換および交換した支払指図に係る資金決済事務を加盟銀行に委託する「決済制度事務委託銀行」がある。

### (2) 統計上の用語

#### ① 同時決済

流動性節約型RTGSで処理された「同時決済口支払指図」の件数・金額

#### ② 通常決済

従来型RTGSで処理された「通常口支払指図」の件数・金額

#### ③ CLS決済分

CLS銀行の「通常口支払指図」の受払合計の件数・金額

### (3) 対象となる取引

#### ① コルレス先円勘定の振替

#### ② 円建送金代金(仕向・被仕向)

#### ③ 輸出入取引代金(円借款輸出代金を含む。)

#### ④ 外国為替市場における売買に伴う円代金

#### ⑤ 証券外為

#### ⑥ 送金カバー

#### ⑦ その他