

2017年6月14日制定

無担保コールO／N物レート行動規範

本行動規範は、日本銀行が無担保コールO／N物レートを算出・公表するに当たり、情報提供会社が行う情報提供に関し必要な事項を定めることを目的とする。

情報提供会社は、無担保コールO／N物レートの定義に即して適切に情報提供を行うにあたり、本行動規範を遵守するものとする。

1. 定義

(1) 「無担保コールO／N物レート」とは、日本銀行が公表する「[コール市場関連統計の解説](#)」に基づき算出する無担保コールO／N物取引にかかるコールレート（加重平均値）とする。

(2) 情報提供会社が提供する情報は、毎営業日の無担保コールO／N物取引にかかる約定レート（小数点第3位まで〈単位未満四捨五入〉）および出来高（億円単位〈単位未満四捨五入〉）とする。

2. 情報提供会社の遵守事項

(1) 定義に基づく情報の提供

情報提供会社は、1. に定める情報を翌営業日の8：50までに、日本銀行金融市場局市場調節課に提供する。

(2) 情報提供部署、情報提供責任者、情報提供担当者の日本銀行への連絡

イ、情報提供会社は、自社における日本銀行への情報提供部署、情報提供責任者および情報提供担当者を特定し、所定の書式・方法により日本銀行に連絡する。

ロ、情報提供責任者は、日本銀行への情報提供に関する責任を有する管理職の者であって、短期金融市場またはその他の関連市場における取引について十分な経験・能力を有すると情報提供会社が判断する者とする。また、情報提供担当者は、自社内における所要の研修等を受けた者であって、情報提供責任者の監督のもとで、適切に日本銀行への情報提供事務を遂行できると情報提供会社が判断する者とする。

ハ、情報提供会社は、イ、で連絡した内容に変更が生じた場合には、所定の書式・方法により速やかに日本銀行に連絡するものとする。

(3) 提供情報の確認体制

イ、情報提供会社は、提供情報の適切性・真正性を確保するのに必要な体制を維持する。

ロ、情報提供会社は、提供情報の適切性・真正性に何らかの問題があった場合またはその疑いがある場合には、速やかに日本銀行に連絡する。

ハ、情報提供会社は、情報提供に関する日本銀行からの照会（提供情報を作成するために使用した原データに関する提供依頼を含む）に誠実に対応する。

ニ、情報提供会社は原データを少なくとも5年間保存する。

(4) 問題発生時の日本銀行への連絡

情報提供会社は情報提供に関し問題が発生したことを認識した場合またはその恐れがある場合には、速やかに日本銀行に連絡する。

(5) 利益相反を適切に管理する体制

情報提供会社は情報提供における利益相反を適切に管理する体制を維持するものとする。なお、ここでの利益相反とは、適切に情報提供を行うべきとの本行動規範と、情報提供会社、情報提供責任者および情報提供担当者の個別的な利益（非金銭的な利益を含む）との間で利害が衝突する状態を指すものとする。

(6) 情報交換・調整等の禁止

情報提供会社の情報提供担当者および情報提供責任者は、社外の者との間で正当な理由なく提供情報に関する情報交換または調整を行ってはならないものとする。

(7) 情報の保管

情報提供会社は次の情報を少なくとも5年間保管するものとする。

イ、情報提供会社において情報提供を管理する手続きやマニュアル

ロ、情報提供に関する利益相反管理体制にかかる資料がある場合は当該資料

ハ、利益相反のおそれがある取引に対するエクスポージャーを把握できる資料
(各社の業務体制や管理の状況も勘案し、自社全体、個々のトレーダー毎等、
適宜の区分で保管)

ニ、情報提供の改善につながるような内部監査、および外部監査の検出事項が
ある場合にはその内容と、当該改善策の進捗状況

(8) 情報の修正

情報提供会社は、提供情報を修正する必要がある場合には、速やかに日本銀行に連絡することとする。

(9) コンティンジェンシー・プラン

情報提供会社は、日本銀行に対し通常の方法により情報提供ができない場合には、速やかに日本銀行宛てに連絡し、協議の上代替方法について決定することとする。

(10) 情報提供の中断・中止

情報提供会社が情報提供を中断または中止しようとする場合には、中断または中止を行おうとする日の3か月前までに、日本銀行と協議することとする。

3. その他

日本銀行と情報提供会社の合意があった場合には、本行動規範を改正することができる。