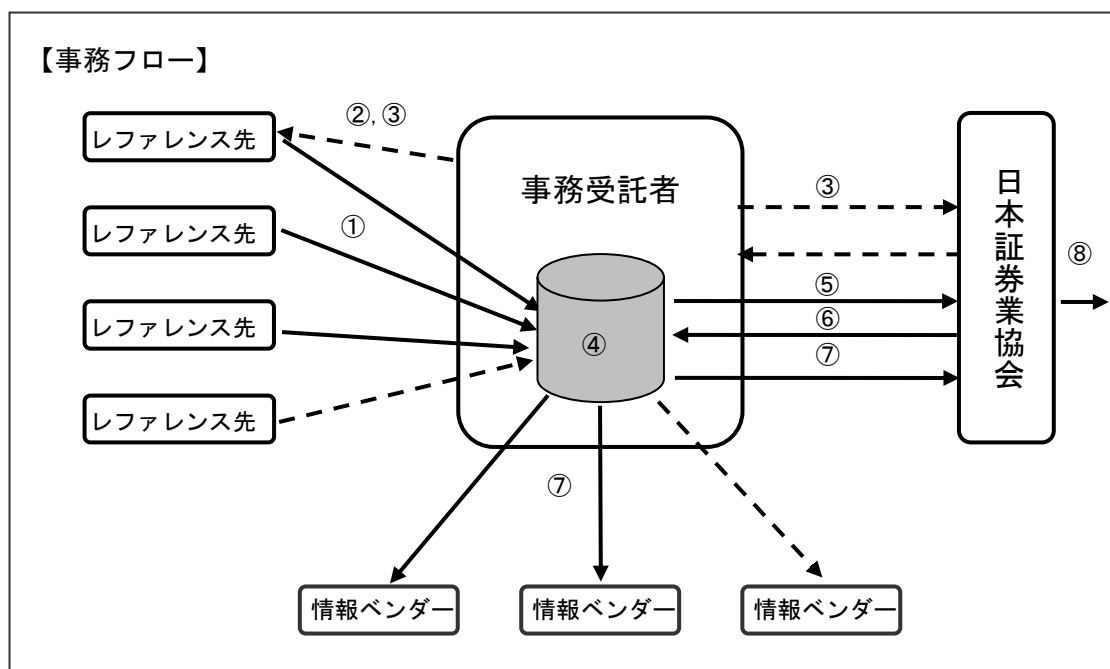


(参考)

東京レポ・レート算出・公表の事務フロー



- ① レファレンス先は、毎営業日、午前11時時点のマーケット・レート（レファレンス先が同時点の市場実勢と考えるレート）を、午前11時45分までに事務受託者に電子的通信手段により報告する。報告するレートについては、各レファレンス先がそれぞれ再鑑し、正確な報告を行う。
- ② 事務受託者は、レファレンス先から報告されるレートの内容を確認し、異常値の可能性があるレート（詳細は日本証券業協会が指定する）又は報告レートの記載漏れがあった場合には、レファレンス先に報告したレートの内容の確認を求める。この場合、当該レファレンス先は、速やかに訂正の可否を回答する。
- ③ 事務受託者は、報告が遅延したレファレンス先がある場合には、当該レファレンス先に対してレート報告を催促するとともに、日本証券業協会にその旨を報告する。この場合、当該レファレンス先は、速やかにレート報告を行う。
- ④ 事務受託者は、各レファレンス先から報告されたレートに基づき東京レポ・レートを算出する。

- ⑤ 事務受託者は、日本証券業協会に、東京レポ・レート及び各レファレンス先から報告されたレートを電子的通信手段により報告する。
- ⑥ 日本証券業協会は、⑤により報告を受けたレートの公表を承認する。
- ⑦ 事務受託者は、日本証券業協会が指定した情報ベンダーに、東京レポ・レート及び各レファレンス先から報告されたレート（レファレンス先名及びレート）を配信する。配信を受けた情報ベンダーは、午後0時30分頃に東京レポ・レート及びレファレンス先ごとの報告レートを公表する。
—— 情報ベンダーによっては、東京レポ・レートのみを公表する場合がある。
- ⑧ 日本証券業協会は、⑦により情報ベンダーが東京レポ・レート及びレファレンス先ごとの報告レートを公表した以後、東京レポ・レートを日本証券業協会のホームページに掲載する。