

## 全銀協T I B O R公表に係るコンティンジェンシー・プラン

### 一般社団法人全銀協T I B O R運営機関

本プランは、一般社団法人全銀協T I B O R運営機関（以下「運営機関」という。）が公表する全銀協日本円T I B O Rおよびユーロ円T I B O R（以下、あわせて「全銀協T I B O R」という。）について、関係諸施設の被災、停電等の事態（以下「非常事態」という。）の発生や、極度の市場ストレスの発生、リファレンス・バンクの減少等によって、運営機関の意図に反して全銀協T I B O Rの算出・公表が困難になる場合に備え、事前の措置、および、そうした事態が発生した場合の措置について定める。

なお、本プランにおける用語の定義については、本プランにおいて定めるほか、運営機関の業務規程および全銀協T I B O R行動規範に定めるところによるものとする。

#### 1. 非常事態の発生に備えた事前の措置

##### (1) 運営機関および関係者における体制整備

- ①運営機関は、何らかの非常事態の発生により、運営機関による全銀協T I B O Rの公表にかかる事務の遂行が困難となる場合に備え、そうした事態が生じた場合に、運営機関の全銀協T I B O R公表にかかる事務を、一般社団法人大阪銀行協会（以下「大銀協」という。）が代行する態勢を整備する。
- ②運営機関、大銀協、リファレンス・バンク、事務代行会社および情報提供会社（以下、リファレンス・バンク、事務代行会社および情報提供会社を総称して「関係者」という。）は、非常事態の発生に備え、非常事態発生時の全銀協T I B O R公表に係る態勢整備のための適切な措置（コンティンジェンシー・プランの作成等）を講じるものとする。

##### (2) 連絡先リストの作成・送付

運営機関は、運営機関の事務局、大銀協および関係者の非常事態発生時の連絡先を記載したリストを作成し、関係者に送付する。

#### 2. 非常事態発生時に実施する措置

非常事態発生時に実施する措置を以下のとおりとする。なお、運営機関が非常事態の影響を受けることとなり、全銀協T I B O R公表にかかる事務を遂行

することが困難と判断される場合には、運営機関は大銀協にその事務の遂行を依頼し、大銀協が関係者にその旨を連絡のうえ、その事務を遂行することとする。この場合、本2.(1)(2)および(3)における「運営機関」は、別に定めがない限り、「大銀協」と読み替えて対応するものとする。

#### (1) 非常事態発生時の連絡

- ① 運営機関は、非常事態が発生した場合には、その状況に応じ、関係者と連絡をとり、状況を把握する。
- ② 関係者は、非常事態の影響を受けることより、全銀協TIBORの公表に影響が生じる可能性が生じた場合には、運営機関および事務代行会社にその旨を連絡するものとする。

#### (2) 基本的な対応

##### ① リファレンス・バンクのレート呈示

- i) リファレンス・バンクは、事務代行会社に対し端末入力によりレート呈示ができない場合には、事務代行会社および運営機関宛に電話回線（電子メール、ファクシミリまたは電話をいう。）経由でレートを呈示する。この場合、リファレンス・バンクは、電話回線経由による運営機関へのレート呈示が完了したことを確認できないときは、レートを運営機関へ持ち込むこととする（運営機関が非常事態の影響を受け、大銀協に全銀協TIBOR公表事務の遂行を依頼した場合を除く。以下のii)においても同じ。）。
- ii) 事務代行会社は、運営機関宛に端末入力または電話回線経由で公表レートを連絡できない場合（呈示の完了確認ができない場合を含む。）には、レートを運営機関に持ち込むこととする。

##### ② 算出

- i) 運営機関は、現行の公表時刻（13時まで）に間に合う最終締切時刻（12時35分：注）まで、リファレンス・バンクからのレート呈示を待つ。なお、この時点で8行以上の呈示がある場合、現行の公表時刻に公表する。
- ii) 12時35分を過ぎてもレート呈示を行うリファレンス・バンク数が8行に満たない場合、13時までリファレンス・バンクからのレート呈示を待つ。13時時点で8行以上の呈示がある場合、全銀協TIBORレートを速やかに算出し、公表する。

- iii) 13 時時点で呈示を行うリファレンス・バンク数が 8 行に満たない場合、14 時 30 分までリファレンス・バンクからのレート呈示を待つ。14 時 30 分時点で 3 行以上の呈示がある場合、全銀協 T I B O R レートを速やかに算出し、公表する。
- iv) 14 時 30 分時点で呈示を行うリファレンス・バンク数が 3 行に満たない場合、17 時までリファレンス・バンクからのレート呈示を待つ。17 時時点で 3 行以上の呈示がある場合、全銀協 T I B O R レートを速やかに算出し、公表する。
- v) 17 時を過ぎてもレート呈示を行うリファレンス・バンク数が 3 行に満たない場合、前日の全銀協 T I B O R レートを当日のレートとして公表するとともに、その旨を公表する。なお、この場合、呈示のあったリファレンス・バンクの呈示レートについては公表しない。
- vi) 上記の場合のレート算出方法は、各期間毎に呈示を行うリファレンス・バンク数に応じ、以下のとおりとする。

- ・ 5 行以上の場合：通常どおり、各期間毎に最高 2 社の値および最低 2 社の値を除外し、単純平均して算出したレート
- ・ 4 行の場合：各期間毎に最高 1 社の値および最低 1 社の値を除外し、単純平均して算出したレート
- ・ 3 行の場合：各期間毎に最高 1 社の値および最低 1 社の値を除外した、残る 1 社のレート

- vii) リファレンス・バンクから一部のタームのレートについてのみ呈示があった場合には、本項の算出においては、呈示があったタームのレートについてのみ、レート呈示銀行と看做すものとする。

(注)「全銀協 T I B O R 行動規範」では、12 時 20 分までにレートを呈示することとなっている。

### ③ 公表

- i) 上記 2. (2)②iv) または v) の場合には、運営機関は 18 時までに全銀協 T I B O R レートを公表する。
- ii) 公表は、原則として、通常時と同様、情報提供会社経由とする。
- iii) 運営機関が、情報提供会社からの公表が困難と判断した場合には、運営機関は全銀協 T I B O R レートを運営機関のホームページで公表

するとともに、外部から非常事態の発生の事実および運営機関の対応状況の確認が可能となるよう対応する。ただし、運営機関が非常事態の影響を受け、大銀協に全銀協T I B O R公表事務の遂行を依頼した場合には、大銀協のホームページで全銀協T I B O Rレートを公表するものとする。なお、情報提供会社からの公表が可能になり次第、順次情報提供会社からの公表を実施する。

### (3) 広域大災害発生等の場合の取扱い

広域大災害発生時等、上記2.(2)②によらずに全銀協T I B O Rの公表を中止することが適切と判断される場合には、運営機関の理事長の決定により、全銀協T I B O Rの公表の中止を決定し、これを公表する。また、運営機関の理事長が事故等により、その職務を行えない場合には、次に掲げる者が、当該順位で理事長の職務を代行するものとする。なお、この場合には、前日の公表レートを当日の全銀協T I B O Rとする。

- ① 運営機関の副理事長
- ② 全銀協T I B O R運営委員会の委員長
- ③ 理事会が事前に指定した者

## 3. 極度の市場ストレスの発生の場合の対応

- (1) 運営機関は、極度の市場ストレスが発生した場合においても、原則として、全銀協T I B O Rの算出・公表を行う。
- (2) 上記市場ストレス時において、リファレンス・バンクの一部からレート呈示が行われない等の事態が発生し、12時35分を過ぎても、レートを呈示するリファレンス・バンクが8行に満たない場合には、上記2.(2)②ii)からvii)の手続により全銀協T I B O Rの算出を行う。この場合の公表については、上記2.(2)③i)ii)iii)および(3)に準じる。

## 4. リファレンス・バンクの減少等の対応

運営機関は、上記以外の何らかの事情によってリファレンス・バンクの一部がレート呈示を取りやめ、当日12時35分を過ぎても、レート呈示を行うリファレンス・バンクが8行に満たない場合においては、上記3.(2)に準じて対応する。

リファレンス・バンクによるレート呈示の取りやめが継続する場合、運営機関はかかる事態を早期に解消するために、リファレンス・バンクの追加等の必要な措置を検討、実施する。

## 5. 本プランの改正

本プランの改正は、理事会の決定によるものとする。

## 6. その他

本プランの運用に必要な事項は、事務取扱要領で定める。

また、事務取扱要領の改正、ならびに、本プランおよび事務取扱要領に定めのない事項については、必要に応じて、理事会が決定する。

## 附 則

1. このコンティンジェンシー・プランの改正は、平成26年4月1日から施行する。
2. 平成27年2月16日付けの改正は、平成27年4月1日から施行する（改正事項：2.（2）①i）、2.（2）②ii）～vii）、2.（2）③i）、2.（2）③iv）、2.（3）、3.（2）、5.、6.）
3. 平成27年11月26日付の改正は、平成27年11月26日から施行する（改正事項：2.（3））
4. 平成28年11月4日付の改正は、平成28年11月21日から施行する（改正事項：2.（2）③iv））
5. 平成29年2月20日付の改正は、平成29年7月24日から施行する（改正事項：2.（2）②i）・ii）・（注）、3.（2）、4.）
6. 平成30年3月16日付の改正は、平成31年4月1日から施行する（改正事項：2.（2）③iii）、3.（2））
7. 令和3年3月22日付の改正は、令和3年3月22日から施行する（改正事項：2.（2）①i）・ii））