

2021 年 9 月 10 日
日本円金利指標に関する検討委員会

TONA 複利（後決め）の利息計算に係る コンベンションのツールの公表について

「日本円金利指標に関する検討委員会」（以下、「検討委員会」）は、無担保コール 0/N 物レート（以下、「TONA」）複利（後決め）のコンベンション（利息計算方式）に関する理解促進を目的として、TONA 複利（後決め）の利息計算に係るコンベンションのツール（以下、「本ツール」）を公表します¹。

本ツールの利用を希望される場合は、別紙の「ご利用上の留意点」をご確認のうえ、検討委員会事務局（post. fmd33@boj.or.jp）までご連絡ください。

以 上

¹ https://www.boj.or.jp/paym/market/jpy_cmte/cmt210910a.htm/

ご利用上の留意点

「日本円金利指標に関する検討委員会」(以下、「検討委員会」)は、無担保コール0/N物レート(以下、「TONA」)複利(後決め)のコンベンション(利息計算方式)に関する理解促進を目的として、TONA 複利(後決め)の利息計算に係るコンベンションのツール(以下、「本ツール」)を公表します。

本ツールを利用される場合には、予め以下の留意点を十分にご理解ください。

なお、本ツールでは、利息計算に係る参考例として、「Lookback 方式」および「Lookback with Observation Shift 方式」を採用していますが、フロアの適用方法等を含め、特定のコンベンションを推奨するものではありませんので、併せてご留意ください。

1. 著作権

- ・本ツールは著作権の対象となっています。著作権は日本国著作権法および国際条約により保護されています。
- ・本ツールの内容を、第三者へ再配付することはできません。
- ・本ツールの内容については、検討委員会に無断で改変を行うことは出来ません。

2. 免責事項

- ・検討委員会は、情報提供を目的として本ツールを配付しており、本ツールの利用、いかなる投資や商品もしくはサービスの購入、または販売についても、推奨・助言し、または保証するものではありません。
- ・検討委員会は、本ツールの配付に当たり、その正確性を確保するよう努めておりますが、これを保証するものではありません。
- ・検討委員会は、利用者が本ツールを用いて行う一切の行為について、何ら責任を負うものではありません。

3. その他

- 本ツールは、2021年6月末時点における後決め複利に係るコンベンションの情報に基づいています。今後、本ツールの内容を更新する予定はございません。
- 本ツールは予告なしに内容を変更し、また配付を終了する場合がありますので、予めご了承ください。
- 本ツールの利用に関するご相談は、検討委員会事務局 (post.fmd33@boj.or.jp) まで電子メールにてお願いします。

以上

(参考)

ハッシュ値について

「日本円金利指標に関する検討委員会」が提供する TONA 複利（後決め）の利息計算に係るコンベンションのツールのハッシュ値は下表のとおりです。

公表日	ハッシュ値 (上段：MD5、下段：SHA1)
2021年9月10日	7c8fa3b7e71e50388dcccdf0ec965e7
	89456432e4eb49683298fe86d24358e604e631ed

以上