

「ターム物 RFR 金利タスクフォース」運営要領

1. 設立の趣旨

本タスクフォースは、「リスク・フリー・レート」として特定された無担保コール 0/N 物レートを参照する日本円 OIS に基づくターム物金利（以下「ターム物 RFR 金利」という。）の算出および公表を希望する主体が、その算出および公表に向けた検討および体制準備等を円滑に開始することを支援するため、「日本円金利指標に関する検討委員会」（以下「委員会」という。）におけるターム物 RFR 金利に関するこれまでの整理をもとに、実務的な検討その他の必要な対応を行う。

2. 検討事項

本タスクフォースは、実務的または専門的な観点から、以下に掲げる事項について検討する。

- ① ターム物 RFR 金利の算出および公表を行う主体の選定にかかる事項
- ② ターム物 RFR 金利のデータ要件にかかる事項
- ③ ターム物 RFR 金利の参考値の算出および公表に向けた体制整備にかかる事項
- ④ ターム物 RFR 金利の確定値の算出および公表に向けた体制整備にかかる事項
- ⑤ その他必要な事項

3. 構成・運営

- (1) 本タスクフォースは、その設立の趣旨に照らし必要な検討その他の対応を迅速に行うため、「ターム物金利構築に関するサブグループ」の共同議長、日本円 OIS の仲介業者、事業会社（金利指標ユーザー）、デリバティブに関

する知見を有する先、法令・コンプライアンスに関する知見を有する先、金融庁および日本銀行から成る少数のメンバーで構成する。

- (2) 本タスクフォースの設立の趣旨に照らし、必要と認められる場合は、メンバー間の協議により、ターム物 RFR 金利の算出および公表を希望する主体その他の関係者を本タスクフォースに参加させることができる。
- (3) 本タスクフォースの事務局は、日本銀行金融市場局市場企画課が務める。事務局は、議事次第の作成およびメンバーへの周知、会場の提供等、本タスクフォースの庶務を処理する。
- (4) 本タスクフォースは、ターム物 RFR 金利の算出および公表に向けた検討等を行う上で必要かつ十分な頻度で開催するものとする。また、本タスクフォースの開催方法については、対面、書面その他メンバー間の合意に基づく方法によるものとする。
- (5) 本タスクフォースにおける検討事項の取りまとめは、意見の一致を原則とする。

4. 報告・公表等

本タスクフォースの会議は原則として非公開とする。ただし、以下の(1)または(2)の場合においてはこの限りでない。

- (1) 本タスクフォースにおける検討事項の取りまとめ結果について、必要に応じて、委員会および傘下のサブグループに説明する場合。この場合、意見の一致による取りまとめが困難な事項については、少数意見についても委員会に報告するものとする
- (2) 設立の趣旨に照らし、検討状況等について公表することが必要と認められる場合

5. 守秘義務等

本タスクフォースのメンバーその他の参加者は、本タスクフォースにおける議論を通じて知ることができた非公開情報を漏らしてはならない。また、本タスクフォースにおける議論を通じて知ることができた情報は、本タスクフォースの目的を達成するためにのみ用いることとし、反競争的な目的や自己または

第三者の利益を図るために用いてはならない。本タスクフォースのメンバーその他の参加者を退いた後も同様とする。

6. 独占禁止法等の遵守

本タスクフォースのメンバーその他の参加者は、その検討に当たり、私的独占の禁止及び公正取引の確保に関する法律（昭和二十二年法律第五十四号）を含む、国内外の適用されうるすべての競争法を遵守するものとする。

7. その他

本タスクフォースの運営に必要な事項で本要領に定めのない事項は、メンバー間の合意に基づき決定するものとする。

以 上