

2019年8月28日

## 「ターム物 RFR 金利タスクフォース」の設立および第1回会合の開催について

先般、「「ターム物 RFR 金利タスクフォース」の設立等について」<sup>1</sup>において、本年8月中を目途に「ターム物 RFR 金利タスクフォース」を設立する旨を公表しておりましたが、本日、同タスクフォースが設立され、第1回会合を開催しましたので、お知らせします。

タスクフォースは、リスク・フリー・レート（RFR）にもとづくターム物金利の算出・公表主体に対して実務的なサポートを迅速に行う観点から、以下の主体および金融庁・日本銀行から成る少人数のメンバーで構成されることとなりました（具体的なメンバーは別紙参照）。

- (1) 「ターム物金利構築に関するサブグループ」の共同議長
- (2) 日本円 OIS のブローカー（データ提供者）
- (3) 事業法人（金利指標ユーザー）
- (4) デリバティブに関する知見を有する先
- (5) 法令・コンプライアンスに関する知見を有する先

今後、ターム物 RFR 金利の算出・公表に向けたタスクフォースでの議論の内容等については、必要に応じて、「日本円金利指標に関する検討委員会」<sup>2</sup>のページにて公表される予定です。

本件に関する照会先：

日本銀行金融市場局市場企画課

大竹（03-3277-1244）、塩沢（03-3277-1246）

以 上

<sup>1</sup> [http://www.boj.or.jp/announcements/release\\_2019/rel190730b.pdf](http://www.boj.or.jp/announcements/release_2019/rel190730b.pdf)

<sup>2</sup> [http://www.boj.or.jp/paym/market/jpy\\_cmte/index.htm/](http://www.boj.or.jp/paym/market/jpy_cmte/index.htm/)

## ターム物 RFR 金利タスクフォースのメンバーリスト

メンバー	(参考)
三菱 UFJ 銀行	「ターム物金利構築に関するサブグループ」の共同議長
シティグループ証券	「ターム物金利構築に関するサブグループ」の共同議長
上田トラディション証券	データ提供者
タレットプレボン	データ提供者
東短 ICAP	データ提供者
三菱商事	金利指標ユーザー
国際スワップ・デリバティブズ協会	デリバティブに関する知見を有する先
金融法委員会	法令・コンプライアンスに関する知見を有する先
金融庁	—
日本銀行	—