

2022年3月2日

## 「金利指標フォーラム」の設立について

「日本円金利指標に関する検討委員会」（以下、検討委員会）は、2018年8月の設立以降、円LIBORに代わる金利指標の選択と利用に関する考え方の整理、実務的な課題や対応策の検討などを通じて、市場参加者の円LIBORからの移行対応を支援してきました。こうしたもとで、本邦市場における移行対応は、幅広い市場参加者の取り組みによって順調に達成できており、検討委員会の活動は区切りを迎えています。

今後は、移行対応が未了の一部の契約や海外法域・外国通貨における移行対応、円金利指標の信頼性向上のための取り組み、円金利指標の選択や利用に関する具体的な課題について意見交換等を行う場として、検討委員会を組織替えのうえで、「金利指標フォーラム」を設立し、活動を継続することとなりました。引き続き、幅広い市場参加者や金利指標ユーザーにご参加いただき、円金利指標を参照する取引が円滑に行われることを目的として、活動していく予定です。

1. 開催頻度 四半期に1回程度（第1回会合は来年度入り後に開催予定）
2. 参加者 金融機関、機関投資家、事業法人等、検討委員会の参加者
3. 事務局 日本銀行金融市場局市場企画課
4. 目的 本フォーラムでは、本邦市場において日本円金利指標を参照する取引が円滑に行われることを目的として、以下の意見交換等を行う。
  - ① 金融市場参加者や金利指標ユーザーによる日本円金利指標の選択や利用に関する意見交換
  - ② 日本円金利指標の選択や利用に関する市場動向・契約慣行等のモニタリングや具体的な課題に関する意見交換
  - ③ 海外法域や外国通貨の金利指標の動向に関するフォローアップ
5. その他 議論の概要および関連資料について、日本銀行ホームページで公表する予定

以上

本件に関する照会先

日本銀行金融市場局市場企画課

清水（03-3277-1244）、千葉（03-3277-1246）