

## 通貨スワップ等ワーキンググループからの報告

インターディーラー間の通貨スワップ市場における気配値呈示の移行について、別紙により、対外的な情報発信を要望したい。

以 上

2021 年 8 月 13 日

日本円金利指標に関する検討委員会

## 通貨スワップ市場における気配値呈示の移行対応について

通貨スワップ等ワーキンググループ（以下、「WG」）において、インターディーラー間の通貨スワップ市場における気配値呈示を LIBOR ベースからリスク・フリー・レート（以下、「RFR」）ベースへ移行する日について、意見照会を実施し、これを 2021 年 9 月 21 日とすることについてコンセンサスを得た。

—— WG は、米国 Alternative Reference Rates Committee（以下、「ARRC」）傘下の Cross-Currency Basis Swap Subgroup 会合において、上記の意見照会結果を踏まえ、移行日を 9 月 21 日とすることを支持。ARRC は、7 月 21 日、インターディーラー間の通貨スワップ市場における気配値呈示（米ドル、英ポンド、瑞フラン、日本円の 4 通貨）を LIBOR ベースから RFR ベースへ移行する日を 9 月 21 日とすること等について、ステートメントを公表した<sup>1</sup>。

検討委員会は、市場参加者が、上記のコンセンサスを踏まえたうえで所要の対応を講じることを期待する。

以 上

---

<sup>1</sup>[https://www.newyorkfed.org/medialibrary/Microsites/arrc/files/2021/ARRC\\_Press\\_Release\\_Endorsement\\_of\\_MRAC.pdf](https://www.newyorkfed.org/medialibrary/Microsites/arrc/files/2021/ARRC_Press_Release_Endorsement_of_MRAC.pdf)