

「日本円金利指標に関する検討委員会」第23回議事要旨

(2021年8月13日(金)、書面開催)

1. ターム物金利構築に関するサブグループ議長からの報告

- ターム物金利構築に関するサブグループより、TONA First (流動性供給者による(ブローカー経由の場合を含む)気配値呈示を、円LIBORベースからTONAベースに移行すること)の実施に関する具体的な取扱いについて、意見照会を実施したことが報告された。また、意見照会結果を踏まえ、「円金利スワップ市場における気配値呈示の移行対応(TONA First)について」¹を公表したことが報告・了承された。

2. 通貨スワップ等ワーキンググループ取り纏め役からの報告

- 通貨スワップ等ワーキンググループより、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(日本円についてはTONA)ベースへ移行する日について、意見照会を実施したことが報告された。また、意見照会結果を踏まえ、「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」²を公表することが了承された。

以 上

¹ https://www.boj.or.jp/paym/market/jpy_cmt/cmt210726b.htm/

² https://www.boj.or.jp/announcements/release_2021/rel210813b.pdf

「日本円金利指標に関する検討委員会」第23回会合 参加者

(メンバー)

議 長	三 菱 U F J 銀 行	合 田 健一郎
副 議 長	野 村 證 券	野々村 茂
	み ず ほ 銀 行	小早川 究
	三 井 住 友 銀 行	折 原 隆 志
	横 浜 銀 行	荒 井 智 希
	栃 木 銀 行	大 野 和 史
	ド イ ツ 銀 行	森 田 茂 樹
	大 和 証 券	佐 藤 真 也
	ゴールドマン・サックス証券	田 口 研 吾
	モルガン・スタンレーMUFG証券	江 塚 剛
	ゆ う ち よ 銀 行	市 川 達 夫
	農 林 中 央 金 庫	原 田 憲 之
	信 金 中 央 金 庫	田 中 宏 之
	第 一 生 命 保 険	甲 斐 章 文
	東京海上ホールディングス	近 松 岳 洋
	大和アセットマネジメント	高 尾 憲 久
	三 井 物 産	田 中 誠
	三 井 不 動 産	今 田 貴 仁
	東 日 本 旅 客 鉄 道	石 丸 幹 人
	三 菱 H C キ ャ ピ タ ル	富 永 修
	日 本 電 信 電 話	中 山 和 彦

(オブザーバー)

全銀協 TIBOR 運営機関	小 山 寛 隆
国際スワップ・デリバティブズ協会	森 田 智 子
金 融 法 委 員 会	戸 塚 貴 晴

(弁護士)

東京金融取引所
日本証券クリアリング機構
全国銀行協会
日本証券業協会
金融庁
日本銀行
日本銀行
日本銀行

野中篤
金子貴比古
高橋哲生
西村淑子
加藤博紀
清水佳充
千葉誠
吉村玄

(敬称略)

以上