

【資料 6】英 RFRWG でのターム物 RFR 金利の運営機関候補先による
プレゼンの実施について

- 英 RFRWG では、昨年 7 月に行われた、リスク・フリー・レート（SONIA）にもとづくターム物金利（TSRR）に関する市中協議を経て、SONIA 参照の OIS 取引をベースに TSRR を構築する方向で検討が進められてきた。こうした中、昨年 12 月には、関心のある金利指標運営機関から意見を募集する文書も公表。
- その後、①FTSE Russell（ロンドン証券取引所の完全子会社）、②IBA（LIBOR 運営機関）および③Refinitiv（前身はトムソン・ロイターの一部門、情報ベンダー）の 3 社が TSRR 構築に取り組んでいることが明らかになり、5/14 日に開催された RFRWG において、各社がプレゼンテーションを実施した旨が公表された¹。
 - FTSE Russell では、清算機関の LCH のほか、トラディションや TP ICAP といったブローカーと連携して指標を構築する方針。
 - IBA では、自らが運営する ICE Swap Rate の手法を活用する方針。
- RFRWG では、こうした動きを歓迎し、TSRR の円滑な構築をサポートするための新たなタスクフォースを設置することを公表。

以 上

¹

<https://www.bankofengland.co.uk/-/media/boe/files/markets/benchmarks/statement-on-the-progress-on-adoption-of-risk-free-rates-in-sterling-markets.pdf?la=en&hash=24893EB812640CC61E640BEB98D8E7415439210B>