

2018年11月8日

「通貨スワップ等ワーキンググループ」運営要領

1. 設置の趣旨

本ワーキンググループは、米国 Alternative Reference Rates Committee 傘下の Cross-Currency Basis Swap Subgroup（以下「CBSS」という。）が通貨横断的な検討を行うことに鑑み、「日本円金利指標に関する検討委員会」（以下「委員会」という。）運営要領2.（1）および5.（1）の定めにかかわらず、CBSS での検討事項についての対応および CBSS 会合での意見表明を行うため、委員会のもとに設置する。

2. 検討事項

本ワーキンググループは、CBSS での検討事項に関して、専門的・実務的な観点から、以下に掲げる事項について検討する。

- ① CBSS の検討事項についての対応案の策定
- ② 上記①に関し日本円金利指標に影響を及ぼしうる課題およびその対応策の整理
- ③ LIBOR 等の金利指標を参照している既存通貨スワップ取引において、LIBOR 等の金利指標が公表停止した場合の手当てに関する整理

3. 構成

本ワーキンググループは、CBSS の運営状況を勘案し、以下の要件を満たす、原則として10先未満のメンバーで構成される。

- （1）ドル円通貨・為替スワップ市場の主要な担い手であること
- （2）ドル円通貨・為替スワップ取引について、専門的・実務的知見を有すること
- （3）CBSS 会合に参加し、同会合での議論に貢献することが可能であること

4. 運営

- （1）開催頻度等

本ワーキンググループは、CBSS 会合の検討事項について対応を行ううえで必要かつ十分な頻度で開催するものとする。また、本ワーキンググループの開催方法については、対面、書面その他メンバー間の合意に基づくものとする。

(2) 委員会における意見集約等

本ワーキンググループは、CBSS における検討事項についての対応方針を委員会の議長および副議長に報告する。委員会の議長および副議長は、委員会メンバーによる検討が必要と認められる場合には、本ワーキンググループの助言に基づき検討事項および回答案の選択肢等を委員会メンバーに提示のうえ、意見集約を行うものとする。

ただし、本ワーキンググループのメンバーは、CBSS における検討上やむを得ないと判断する場合には、CBSS において意見表明をした後に、委員会の議長および副議長に報告する扱いとすることを妨げない。また、この場合において、委員会の議長および副議長は、委員会メンバーへの報告が必要と認められる場合には、委員会メンバーに報告するものとする。

5. その他

本ワーキンググループの参加者は、非公開情報の取扱い、独占禁止法等の遵守その他の事項について、委員会運営要領に従う。

以 上