

Press release

28 October 2021

リフィニティブ、LIBOR からの移行を促進する新たな金融ベンチマーク 東京スワップレート (TONA 参照) を公表開始

ロンドン証券取引所グループ (LSEG) のリフィニティブは、日本円の金利スワップのベンチマークである東京スワップレートの新バージョンとして、東京スワップレート (無担保コール翌日物金利 (TONA) 参照) を 10 月 28 日から公表開始します。

2021 年 3 月 5 日には、英国金融行為規制機構 (FCA) がすべての日本円 LIBOR について、2021 年 12 月 31 日をもって公表を停止することを発表しております。

リフィニティブは、LIBOR からの移行と新たな市場慣行の導入を支援するベンチマークとして、東京スワップレート (TONA 参照) を導入します。このベンチマークは、英国ベンチマーク規制に基づき Refinitiv Benchmark Services (UK) Limited が管理しており、ディーラー対顧客の間で取引されるスポット・スタートの TONA を参照する OIS の執行可能な気配値を基に 1 年から 40 年までのテナーを公表します。リフィニティブは一次データを Tradeweb から、二次データを TP ICAP から入手します。データは、毎日 10:30(東京時間) と 15:30(東京時間)の公表時刻前の 20 分間に収集されます。

LSEG の LIBOR 移行・ベンチマーク & インデックス部門の責任者であるジェイコブ・ランクブロードリー (Jacob Rank-Broadley) は、次のように述べています。「世界の金融市場が LIBOR からの移行を進める中、当社の東京スワップレート (TONA 参照) の発表は、新しい市場慣行への移行を促進するための重要なステップとなります。市場が大きな不確実性やストレスの中でも機能し、成長し続けるためには、経験豊富なプロバイダーによって管理され、最高の規制基準に準拠した堅牢で透明性の高いレートがこれまで以上に求められています。」

東京スワップレート (TONA 参照) は、Workspace、Eikon、DataScope、Refinitiv Real-Time などのリフィニティブ製品からアクセス可能です。企業は、金融契約や生産システムで即時、このベンチマークを使用することができます。

リフィニティブでは、東京スワップレート (TONA 参照) に、業界の [コンサルテーション](#) で得られたフィードバックに基づいて一定のスプレッド調整を加え、東京スワップレート・フォールバックのプロトタイプを公表しています。フォールバックには 1 年から 40 年までのテナーがあり、東京スワップレート (TONA 参照) ベンチマークと同じ時刻に公表されます。東京スワップレート・フォールバックは、年末までプロトタイプとなります。東京スワップレート・フォールバックは、2022 年初頭にプロダクション・ベンチマークとなる予定です。東京スワップレートの詳細については、[こちら](#)をご覧ください。

Press release

28 October 2021

リフィニティブは、国際金融システムの心臓部である金融ベンチマークの算出、設計、管理、公表における長年の実績があります。リフィニティブの金融ベンチマークの詳細は[こちら](#)を参照ください。

リフィニティブについて

Refinitiv（リフィニティブ）はロンドン証券取引所グループ（LSEG）のグループ企業として、金融市場のデータとインフラストラクチャを提供する世界有数のプロバイダーです。Refinitivは、190カ国で4万余りの企業・機関、40万を超える利用者を擁し、世界全体で金融にかかわる市場参加者を支えています。お客様が自信を持って重要な投資や取引、リスク判断を実行できるように、情報とインサイト、テクノロジーを提供しています。独自のオープン・プラットフォームとクラス最高のデータおよび専門知識を組み合わせることで、選択と機会に結び付け、お客様とパートナーの皆様のパフォーマンス、革新、成長を促進してまいります。詳しくはウェブサイトをご参照ください。 <https://www.refinitiv.com/ja>

本件に関する連絡先

リフィニティブ 広報代行（共同ピーアール株式会社）
大塚、亀田、大谷
refinitiv-pr@kyodo-pr.co.jp