

ISDA® JAPAN MONTHLY UPDATE

2017年11月

コミッティ活動

REGULATORY: 担当 森田 (tmorita@isda.org) / 洞口 (khorauchi@isda.org)

日本円ベンチマーク・ワーキンググループ

11月6日、日本円ベンチマーク・フォールバック・ワーキンググループの会議が開催され、USD/GBP/EUR/CHFのワーキンググループと、Fallback Spread Calculation and Term Fixing Sub-Groupでの検討内容のアップデート、および日本円IBORのフォールバックと今後の進め方について検討が行われた。また、2017年11月2日に、ISDAがベンチマークの移行に関する総合的分析とロードマップの作成を行うことを公表したことについて、メンバーに報告された。グローバルで活動するコンサルティング会社が必要な調査を行うことになる。

11月21日、ISDAは金融庁と会合を行い、日本円ベンチマーク・ワーキンググループのメンバーから提議された、新しいフォールバックの導入を行うための修正を行うことによって修正後の取引は証拠金規制の対象となるか否かに関する懸念について情報共有を行った。本件は、各国当局にも認識されており、最近公表されたFSBレポートにも明記されている。

OPERATIONS AND DOCUMENTATION: 担当 森田 (tmorita@isda.org) / 洞口 (khorauchi@isda.org)

トムソン・ロイター アップデート JPNU, JPNV, JPNW, TKFE, TKFE2, TKYFX - プライマリーデータソースの時間毎更新への変更/クロスレート

11月19日付けMultiple Currency Pair Rate Source Definitions of Annex A to the 1998 FX and Currency Options Definitionsのアップデート版が公表された。[新しい定義集](#)はISDAウェブサイトです入手可能。

トムソン・ロイターのTKFE, TKFE2, TKYFXのスクリーンページの為替レートを参照している金融取引仕様のThe Bilateral Amendment Agreementの雛形は12月初旬に公表される予定。

トムソン・ロイターFXFIX, FXCLOSE, FXFIX30 アップデート

ISDAのウェブサイトリニューアルにつき、[MTM Matrixのページ](#)が移動した。

DATA & REPORTING: 担当 洞口 (khorauchi@isda.org)

固有商品識別子 (UPI)

11月17日、MiFIRの取引報告義務適用開始日が近づいてきたことを受け、ISDAは関連するメンバーである、各々市場参加者、インフラ提供社を対象にANNA DSB サービスを利用したISIN取得要件の準備状況について確認するためのアンケートを行った。

11月22日、ISDAは11月19日付けでFSBあてに[市中協議文書](#)への[回答](#)を提出した旨のメモを回覧した。

コミッティ並びに作業部会会合/コンファレンスの予定

JPY Benchmark Fallback Working Group
(日本語による会議)

12月4日、21日

ISDA Symposium - Financial Benchmarks

An Entirely new framework which affects administrators, contributors and users
(日本語によるシンポジウム)

12月6日

ISDA Japan Trust Bank's Fund Account Subgroup
(日本語による会議)

1月26日

Japan Collateral Working Group
(日本語による会議)

1月31日