

2019年12月4日

ニューヨーク連邦準備銀行による「SOFR Averages および SOFR Index の公表に係る意見募集」に対する全銀協コメント

一般社団法人全国銀行協会

全国銀行協会として、ニューヨーク連邦準備銀行が本年11月4日に公表した「SOFR Averages および SOFR Index の公表に係る意見募集」に対し、コメントの機会を与えられたことに感謝の意を表したい。

最終化に当たって我々のコメントを考慮いただくことを期待する。

記

5. Are there any other changes to the averages or index as proposed that would make them more useful? For what purpose(s)?

SOFR Index については、提案されている「小数点以下8桁」より多くの桁数について表示することを検討いただきたい。

(理由)

SOFR Index について、小数点以下8桁に四捨五入した場合、「公表されている SOFR Average」と「SOFR Index から計算される SOFR Average」に若干の差異を生じることが指摘されている。桁数を多く表示させることにより、両者が限りなく一致するのであれば、正確性が担保され、より有用かつ広範に利用される指標になると考える。

以上