

金利指標フォーラム

「米ドルLIBORの移行対応と円LIBORの代替金利指標の利用 に関するアンケート調査」結果概要

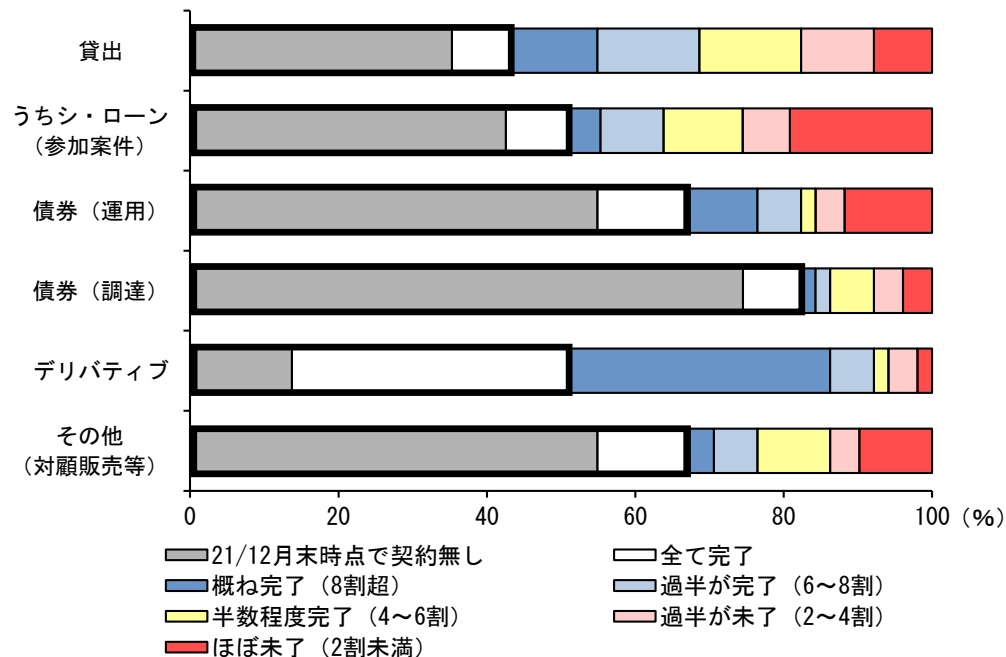
調査対象 : 金利指標フォーラム参加者（メンバー、オブザーバー、傍聴者）のうち
協会・業界団体等を除く51社

調査期間 : 2023年2月20日～3月6日

米ドルLIBORの移行対応の進捗状況【23/3月末見込み】

- ・ 23/3月末時点で移行未了契約がない先（「移行が全て完了」「参照契約無し」）の割合は、貸出で約40%、デリバティブで約50%、債券（運用）で約70%、債券（調達）で約80%。
- ・ 移行未了契約を有する先では、移行が「概ね完了（進捗8割超）」「過半が完了（同6～8割）」とした先から、「ほぼ未了（同2割未満）」とする先まで区々。

移行対応の進捗状況・進捗率
(回答先の分布)

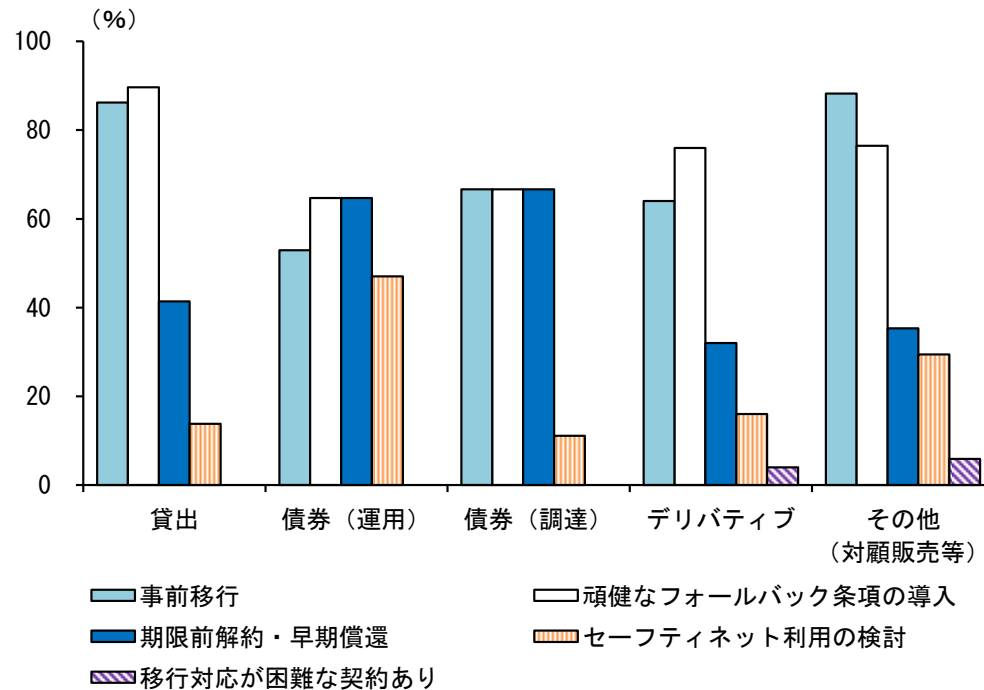


(注) 23/3月末時点で移行対応（事前移行・フォールバック条項導入等）が完了する契約の総数を、21/12月末時点の契約の総数と比較。

米ドルLIBORの移行未了契約の対応方針

- ・ 移行未了契約の今後の対応について、貸出・デリバティブでは事前移行やFB条項導入、債券ではこれに加えて期限前解約・早期償還による対応を、並行して進める方針の先が多い。

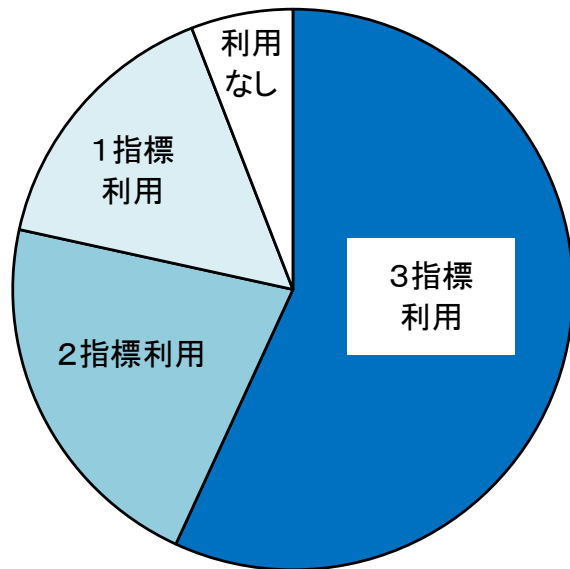
移行未了契約の対応方針
(複数回答可)



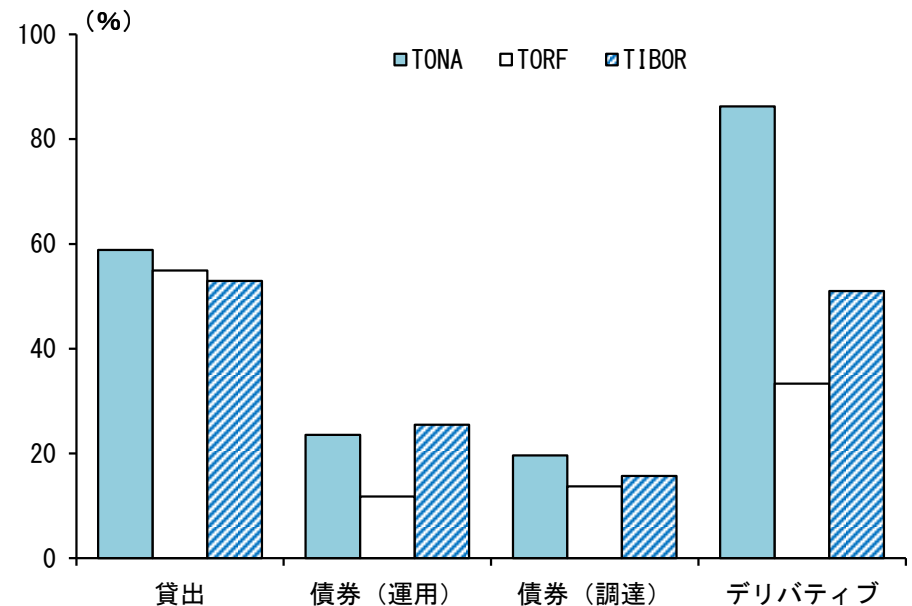
(注) 移行未了契約を有する先に占める割合。

円LIBORの代替金利指標の利用状況

- ・ TONA後決め複利、TORF、TIBORのうち、3つの指標を利用している先は約60%。2つの指標を利用している先は約20%。
- ・ デリバティブのほか、貸出、債券（調達）でも、TONAを利用している先の割合が相対的に高い。

代替金利指標の利用状況
(構成比、%)

(注) 利用している代替金利指標 (TONA、TORF、TIBOR) の数。

契約類型別・指標別の利用状況
(複数回答可)

(注) 回答先 (51先) 全体に占める割合。