

金利指標フォーラム

「米ドルLIBORの移行対応等に関する アンケート（第2回）調査」結果概要

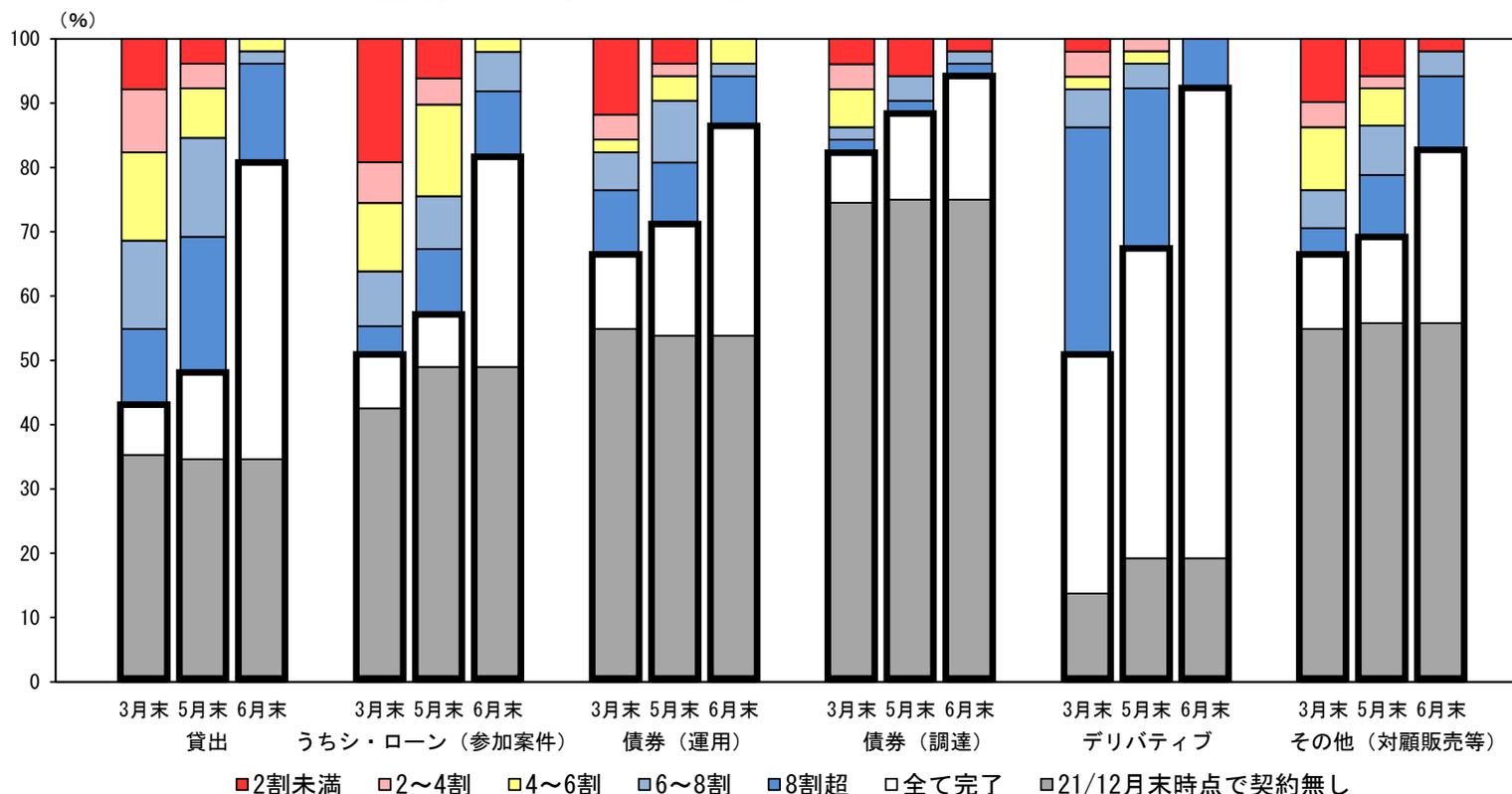
調査対象 : 金利指標フォーラム参加者（メンバー、オブザーバー、傍聴者）のうち
協会・業界団体等を除く52社

調査期間 : 2023年4月25日～5月12日

米ドルLIBORの移行対応の進捗状況

- ・ 23/6月末時点の進捗状況（見込み）は、いずれの契約類型でも、80%以上の回答先が、移行未了契約がない（「移行が全て完了」「参照契約無し」）と回答。
- ・ 移行未了契約を有する先でも、進捗率が「8割超」の先が大半を占めている。3月末・5月末比で、着実に進捗する見通しとなっている。

類型別の移行対応の進捗状況（回答先の分布）

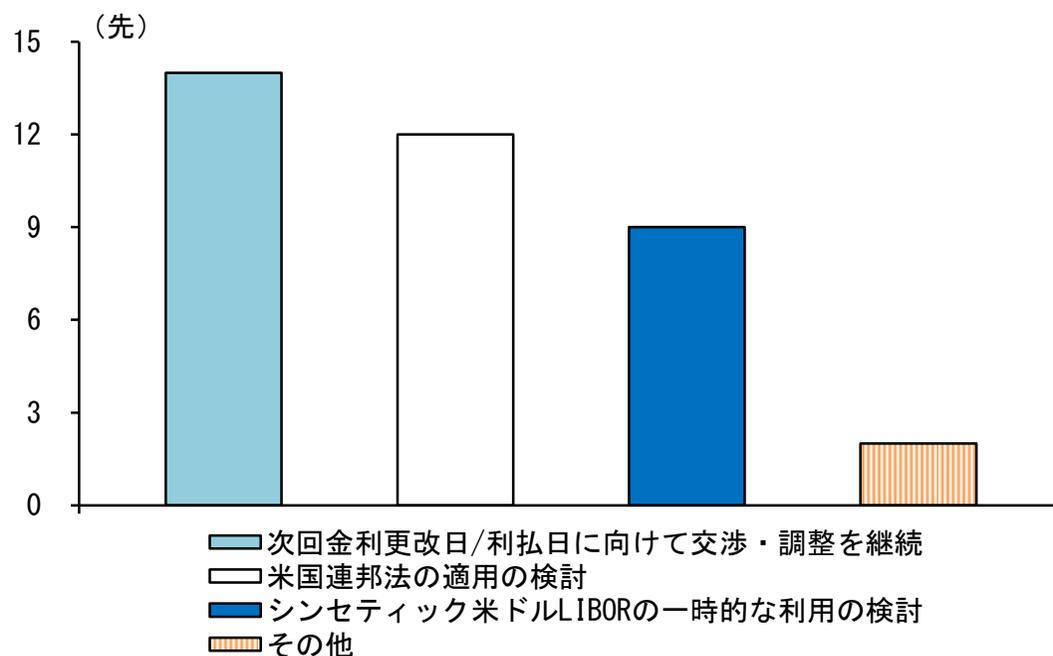


(注) 各時点で移行対応（事前移行・フォールバック条項導入等）が完了する契約の総数を、21/12月末時点の契約の総数と比較。

23/6月末時点での移行未了契約の対応方針

- ・ 23/6月末時点で移行未了契約を有する先（全52先中18先）は、その大半の先が、「（23/7月以降の）次回金利更改日に向けて交渉・調整を継続する」、「米国連邦法の適用を検討する」方針としている。また、「シンセティック米ドルLIBORの一時的な利用を検討する」先もある。

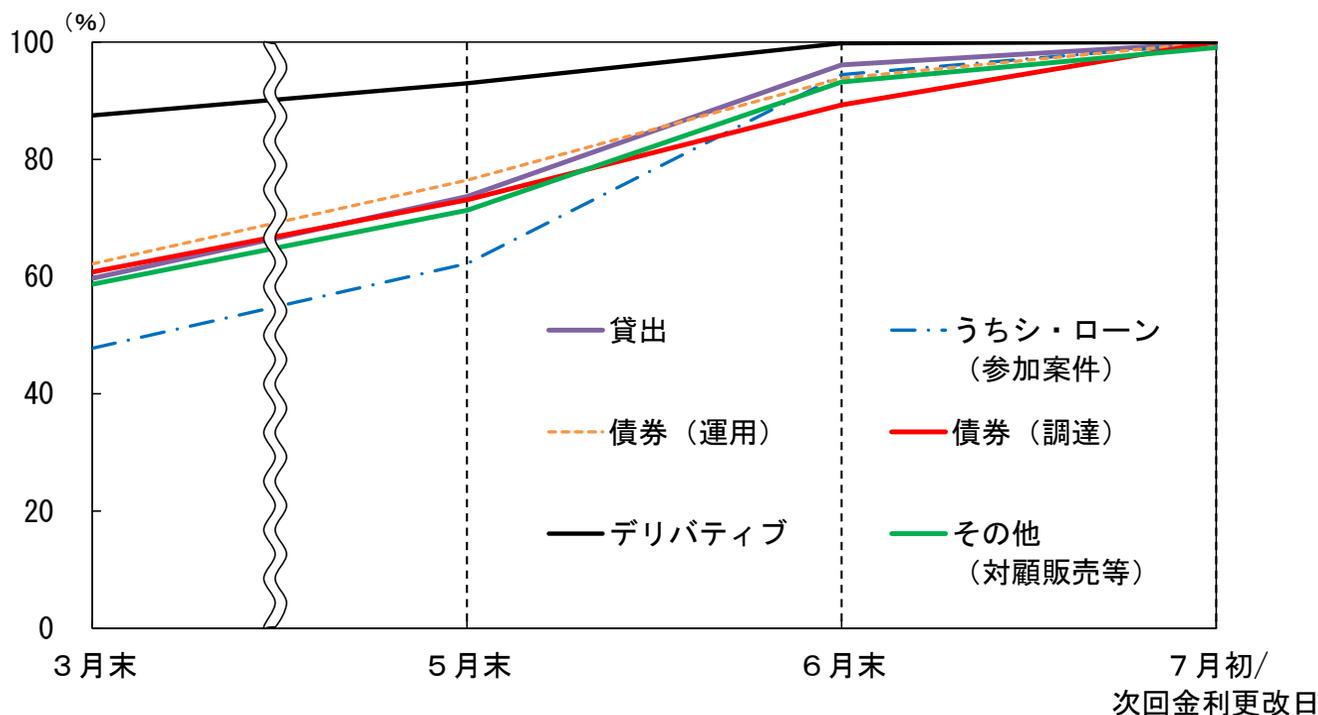
移行未了契約の対応方針（複数回答可）



移行対応の進捗率の見通し

- ・ 回答先の進捗率を単純平均すると、23/5月末時点で、貸出および債券が70%超、デリバティブが90%超。23/6月末時点では、いずれの契約類型でも約90%に上昇。

移行対応の進捗率（回答先平均、契約を有する先のみ）



(注) 各時点で移行対応（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。21/12月末時点で契約を有する先の単純平均値。3月末と5・6月末では、アンケート調査での選択肢の粒度が異なるため、単純には比較できない。7月初/次回金利更改日の割合は、回答先の対応方針をもとに算出した見通し。