

# 業界団体との意見交換会において金融庁が提起した主な論点

令和5年1月

(LIBOR 関連抜粋)

[日証協、投信協]

[日証協]

## LIBOR からの移行対応について

- ドル以外の LIBOR は 2021 年 12 月末に公表停止した。円とポンドの一部テナー（期間）について、市場データを用いて算出する擬似的な LIBOR、いわゆる「シンセティック LIBOR」が、2022 年 1 月以降、時限的に公表されていたが、このうち、シンセティック「円」LIBOR は 2022 年 12 月末に公表停止した。残るシンセティック「ポンド」LIBOR についても、1 か月物と 6 か月物は 3 月末に公表が停止される。これまでのモニタリングを通じて、シンセティック LIBOR の移行対応は概ね順調に進捗していると評価しているが、エクスポージャーを有する金融機関におかれては引き続き対応をお願いしたい。
- また、2023 年 6 月末に公表停止が予定されているドル LIBOR についても、現時点においては、移行対応に特段大きな問題は見受けられないが、時間軸を意識したドル LIBOR からの移行対応を引き続きしっかりと進めていただきたい。
- 金融庁としても、引き続き日本銀行とも連携して各金融機関の移行対応をモニタリングするとともに、その状況に応じた対応の徹底を求めていく。

[投信協]

## LIBOR からの移行対応について

- ドル以外の LIBOR は 2021 年 12 月末に公表停止した。円とポンドの一部テナー（期間）について、市場データを用いて算出する擬似的な LIBOR、いわゆる「シンセティック LIBOR」が、2022 年 1 月以降、時限的に公表されていたが、このうち、シンセティック「円」LIBOR は 2022 年 12 月末に公表停止した。残るシンセティック「ポンド」LIBOR についても、1 か月物と 6 か月物は 3 月末に公表が停止される。これまでのモニタリングを通じて、シンセティック LIBOR の移行対応は概ね順調に進捗していると評価しているが、シンセティック LIBOR の利用がある金融機関におかれては引き続き対応をお願いしたい。
  
- また、2023 年 6 月末に公表停止が予定されているドル LIBOR についても、現時点においては、移行対応に特段大きな問題は見受けられないが、時間軸を意識したドル LIBOR からの移行対応を引き続きしっかりと進めていただきたい。
  
- 金融庁としても、引き続き日本銀行とも連携して各金融機関の移行対応をモニタリングするとともに、その状況に応じた対応の徹底を求めていく。