

## プレスリリース

2021年1月22日  
ブルームバーグ・エル・ピー

\*本プレスリリースは Bloomberg が 2021 年 1 月 20 日に英語で発表を行ったプレスリリースを日本語に翻訳・再編集したものです。オリジナルのプレスリリースの正式言語は英語であり、この内容および解釈については下記の英語版が優先となります。英文オリジナルにつきましては[こちら](#)のサイトをご参照ください。

### ブルームバーグ、IBOR 移行に向けて、 ショートターム・クレジットセンシティブ・インデックスを提供開始

【ニューヨークー2021年1月20日】ブルームバーグは本日、ブルームバーグ・ショートターム・バンクイールド・インデックス(BSBY)の提供を開始したことを発表しました。クレジットセンシティブインデックスへのマーケット需要に応えるため、FRBが新たなリスクフリーレート(RFR)として選定した担保付翌日物調達金利(SOFR)の補足として提供され、世界的なIBOR(銀行間調達金利指標)移行をサポートします。ブルームバーグは、2020年10月15日に、検証と分析を目的とした試験運用のために、BSBYの提供を開始していました。

BSBYは、日次ベースで算出され、アメリカ東部時間(ET)午前8時に公表されます。ブルームバーグ・ターミナル上でアクセス可能です。また、オーバーナイト(BSBYON <Index>)、1ヶ月(BSBY1M <Index>)、3ヶ月(BSBY3M <Index>)、6ヶ月(BSBY6M <Index>)、12ヶ月(BSBY12M <Index>)の5つの金利期間(テナー)から選択することができます。BSBYの利用方法に関する詳細は、[こちら](#)をご覧ください。

BSBYは、コマーシャル・ペーパー(CP)、譲渡性預金(CD)、米ドルの銀行預金、短期銀行債取引を中心とした匿名データを集計して組成されており、銀行の最低調達金利を反映しています。また、システミック・クレジット・スプレッドやターム・ストラクチャーが含まれており、レンディング・マーケットにおけるSOFRの補足として利用することもできます。ブルームバーグは、市場参加者からBSBYに関するフィードバックを参考として開発に活かし、今後もインデックスの更なる改善のために、緊密に協働していきます。市場参加者に試験的に利用いただくベータテスト期間を経て、ブルームバーグ公認のベンチマーク・アドミニストレーターであるブルームバーグ・インデックス・サービス・リミテッド(BISL)を介して、金融のベンチマークとしてBSBYを認可する予定です。

ブルームバーグのインデックス関連商品部門ヘッドであるウメッシュ・ガジリア(Umesh Gajria)は次のように述べています。「SOFRに関連する市場における流動性を高めるために

弊社も寄与し、SOFR のベンチマークとしての適用を推進するためのソリューションの実行を今後も続けて参ります。ブルームバーグには、クレジット・インデックス市場での強みや、債券市場での長い実績を有しています。債券市場におけるブルームバーグのポジションを活かし、IBOR 移行を推し進めるために必要なソリューションとして BSBY を提供することができるかと確信しています」

ブルームバーグは、RFR のポートフォリオへの影響を測るためのシナリオ分析など、IBOR 移行を推進するための総合的なソリューションを提供しています。ブルームバーグ・ターミナル上で、ユーザーは、ポートフォリオ内で IBOR に関連する証券を特定するためのフォールバック・データセットや、RFR を活用した取引サービスをご利用いただくことができます。さらに、ブルームバーグは、国際スワップ・デリバティブ協会 (ISDA) が特定の IBOR に対して実施する予定のフォールバックのためのターム調整やスプレッド調整を公表しています。

## ブルームバーグについて

ブルームバーグは、世界のビジネス・金融情報およびグローバルニュースを提供する情報サービス企業です。情報・人・アイデアをダイナミックなネットワークでつなぎ、有力な意思決定権者にビジネスの勝敗を左右する強力な情報ツールを提供します。ブルームバーグの最大の強みは、迅速かつ正確なデータ、ニュース、分析機能を革新的な技術を用いて提供していることで、これがブルームバーグ ターミナル・サービスの中核を成しています。ブルームバーグのエンタープライズ・ソリューションは、この中核となる情報・技術の上に構築されており、組織全体におけるデータや情報へのアクセスから統合、配信、管理まで、より効率的かつ効果的な業務遂行を支援します。詳細については、[www.bloomberg.com](http://www.bloomberg.com) をご覧いただくか、[デモをリクエスト](#)してください。