

2024年11月7日
商工中金

2021年12月末までに当金庫で金利スワップを取り組まれたお客さまへ デリバティブ取引の時価参考値の算出方法変更について

平素より格別のご高配を賜り誠にありがとうございます。

商工中金が提供しているデリバティブ取引の時価評価額の参考値（※1）について、2024年11月25日時点の時価評価額より、その算出方法を変更することになりましたので、事前にお知らせします。

（※1）取引残高報告書（四半期毎に送付）、時価評価額のお知らせ（お客さまのご要望の頻度で送付）等の「時価評価額欄」に掲載。

算出方法変更の対象商品は、「2021年12月31日までに取引を行った金利スワップ」です。

今回の変更は、一般社団法人全銀協 TIBOR 運営機関がユーロ円 TIBOR の恒久的な公表停止を決定（※2）したことに伴うものです。ユーロ円 TIBOR の公表停止は2024年12月末ですが、デリバティブ取引の清算機関である株式会社日本証券クリアリング機構（JSCC）が同年11月25日に清算対象取引の参照金利をユーロ円 TIBOR から別指標に移行するため、当金庫も同様の対応を行います。

（※2）詳細は全銀協 TIBOR 運営機関のホームページをご覧ください。

https://www.jbatibor.or.jp/news/tibor_18.html

なお、今回の変更は時価参考値の算出方法であり、ご契約いただいているお取引の受払い条件等が変わることはありません。

ご不明な点等ございましたら、下記窓口までお問い合わせください。

【お問い合わせ先】

商工中金（株式会社 商工組合中央金庫）市場営業部 TEL. 0120-281-173
受付時間：銀行営業日 9時～17時