

平成 24 年 1 月 24 日

株式会社三菱東京 UFJ 銀行

### **三菱商事株式会社向け高流動性シンジケートローンの組成**

～ローンセカンダリー市場におけるローン債権の本格的な売買・更なる市場拡大の契機に～

株式会社三菱東京 UFJ 銀行（アレンジャー兼エージェント）と株式会社みずほコーポレート銀行（ジョイント・アレンジャー）は、三菱商事株式会社と共同で開発した、ローン債権の売買を前提としたシンジケートローン（以下、「高流動性シローン」）の第 13 回号の組成を行い、平成 24 年 1 月 24 日付で契約を締結致しました。

三菱商事株式会社向け高流動性シローンは平成 16 年の第 1 回号組成から 7 年が経過し、今回が第 13 回目の組成となります。第 1 回号の組成以降、アレンジャー両行は積極的なマーケットメイク（売買価格を常時提示すること）の継続によりマーケット指標を創出し、これまで数多くの金融機関との間でローン債権の売買を成立させてきています。また、残存期間が短くなった債権の取引により、短期運用ニーズを有した従来とは異なる投資家層のローンセカンダリー市場への参加を実現しております。多様な年限の債権が市場で流通することにより、投資家層の裾野が更に広がることを期待しています。

現在、ローンセカンダリー市場は、日本銀行、金融庁などの公的機関のバックアップのもと、日本ローン債権市場協会（JSLA）加盟金融機関を中心に市場の整備が進められています。三菱東京 UFJ 銀行は、高流動性シローンの導入及びローンセカンダリー市場における売買実績の蓄積によって、既存参加金融機関の利便性向上はもとより、新たな金融機関の参加などによる更なるローンセカンダリー市場の発展を目指しています。

間接金融のウエイトが高い本邦金融市場において、ローンセカンダリー市場が発展することにより、金融機関がローン・ポートフォリオを機動的にコントロールすることを可能とし、且つ企業の資金調達コストが市場の価格形成プロセスを経ることにより透明性が向上することで、本邦における企業の資金調達の合理性と利便性の一層の向上に繋がるものと考えています。取引参加者である金融機関の拡大とともに、高流動性シローン市場に参入する調達企業数は増加しており、市場における高流動性シローンのコンセプトは着実に浸透してきております。

三菱東京 UFJ 銀行は、三菱商事株式会社がこの高流動性シローンに継続的に取り組んでいくことを通じて、更なる参加金融機関の拡大と共に、企業による高流動性シローンの利用拡大が加速することを期待しています。また、本格的なローンセカンダリー市場の発展によって直接金融と間接金融の垣根が更に低くなることで、本邦金融市場が金融機関にとって容易にアクセス可能な互換性の高い総合金融市場へ発展すると共に、企業の資金調達の利便性が一層向上することを期待しています。

以 上

<ご参考>

【本シンジケートローン概要】

1. 借 入 人 : 三菱商事株式会社
2. アレンジャー : 株式会社三菱東京 UFJ 銀行
3. ジョイント・アレンジャー : 株式会社みずほコーポレート銀行
4. 組 成 金 額 : 300 億円
5. 借 入 期 間 : 5 年 (期日一括返済)
6. 表 面 利 率 : 3 ヶ月物 BBA LIBOR に、ローンセカンダリー市場で取引されている  
プライスを前提としたスプレッドを上乗せした変動金利
7. 資 金 使 途 : 一般事業資金
8. 契 約 締 結 日 : 平成 24 年 1 月 24 日
9. 貸 付 実 行 日 : 平成 24 年 1 月 27 日
10. 債 権 格 付 : AA- (R&I) 、 A1 (Moody's) 、 A+ (S&P) を取得