

米ドル新指標を参照するCD（譲渡性預金）の発行について

株式会社みずほ銀行（頭取：藤原 弘治）は、ニューヨーク支店において、米ドル建て SOFR（有担保翌日物調達金利）連動 CD（Certificate of Deposit、譲渡性預金）を 2019 年 2 月 22 日に発行しました。

SOFR（Secured Overnight Financing Rate）とは、2021 年末以降公表が停止される懸念が高まっている USD LIBOR（London Interbank Offered Rate）の代替指標としてニューヨーク連邦準備銀行が 2018 年 4 月から公表を開始した米ドル新指標で、翌日物レポ取引を参照としたリスクフリーレート（銀行の信用リスクを含まない翌日物金利）です。

公表開始後、SOFR を参照する 1 ヶ月物・3 ヶ月物の先物取引や、金利スワップの清算（クリアリング）が開始される等、SOFR を参照した金融取引の基盤は徐々に拡大しており、現在の USD LIBOR からの切り替えによる金融指標の信頼性・透明性の向上が期待されています。

2018 年 7 月以降、米政府系機関や一部の欧米金融機関が SOFR 連動債券や CD の取扱を開始するなかで、今般、邦銀として初めて、みずほ銀行ニューヨーク支店が米国機関投資家向けに SOFR 連動 CD を新規に発行しました。

- 発行体：みずほ銀行 ニューヨーク支店
- 発行金額：200 百万ドル（約 221 億円）
- 発行日：2019 年 2 月 22 日
- 期間：6 ヶ月

SOFR を参照とした金融取引は、今後も取引量および取引基盤の拡大が予想されます。本件発行を通じ米国金融市場における SOFR 取引の拡大に貢献するとともに、発行を通じて得た新指標に関する知見・ノウハウを集積し、グローバルに活用することで、今後の商品開発、お客さまの資金調達サポートに、〈みずほ〉一体となって取り組んでいきます。

以上