

《資金需給》

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		700	▲ 300	0
財政		4,000	▲ 12,100	▲ 29,000
資金過不足		4,700	▲ 12,400	▲ 29,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		11,300		
64,873		▲ 13,600		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		20,000		
国庫短期証売却				
国債買入		11,500	4,400	
CP等買入				3,500
		▲ 300	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援				
3,251				
社債等買入		1,300		
ETF買入		300		
国債補完供給		200		
小計		30,700	4,000	3,500
当預増減		35,400	▲ 8,400	▲ 25,500

当座預金残高	2,118,200	5/19以降の残り所要積立額	135,300
準備預金残高	1,927,100	5/20以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,584,900	積数	95,400
超過準備	1,573,600	1日平均	3,500
非準備先残高	191,100	積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,010,600
準備預金進捗率	95.26% (実績)		12.90% (日数)

5/18のマナタリーベース		3,021,200	
5/18コール 合計	186,039	無担	58,744
		有担	127,295
コール前日増減	計 ▲ 3,568	無担	▲ 4,269
		有担	701

5/19の加重平均レート(速報)				5/18の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.050 ~0.130 (0.069)	0.030	~0.040 (0.031)		O/N	0.055 ~0.125 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.058 ~0.125 (0.077)				T/N		0.058 ~0.121 (0.073)		
				S/N				
0.117 ~0.200 (0.159)				1W		0.065 ~0.130 (0.116)		
0.180 ~0.340 (0.207)				2W		0.118 (0.118)		
				3W				
0.280 (0.280)		0.08-0.13	-	1M	0.170 (0.170)			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.002-0.004	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.01	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完 4,000億円 5/19 ~ 5/20 (1日間) 応札 4億円 落札 4億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 5/21~5/29 (8日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.620%

5年利付国債(表面利率0.1%) 応札6兆4,433億円 落札2兆3,005億円(I 非競争入札:1,976億円) 5/21~2020/3/20 0.102% 按分34.9061% 平均0.100%

交付税特会 1兆500億円 5/28~11/27 応札3兆1,850億円 落札1兆500億円 0.083% 按分100.0000% 平均0.082%

《 5/20の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,109,800	前日比	▲ 8,400
O/N	0.06~0.07	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12

無担O/Nは0.06%台後半での出合いが中心になると見込まれる。

《 19日のインターバンク市場動向 》

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比4兆1,000億円増の162兆1,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の211兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.067~0.069%での調達で始まった。当座預金残高が過去最高となったものの、調達姿勢に大きな変化はなく、出合い一巡後も、0.065~0.067%で底堅く推移するなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

《 19日のオープン市場動向 》

短国現先レートS/Nは前日からほぼ変わらずであった。短国アウトライト市場は、3M:0.002~0.004%、1Y:▲0.01%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、発行案件が乏しく閑散。入札ベースでの発行総額は800億円弱に止まった。発行レートは概ね横ばい圏の取引となった。

《 20日の材料 》

*1-3月期のGDP1次速報(市場予想：前期比年率+1.5%)
*3月の景気動向指数改訂状況

《コール4月積み期間分の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.06570%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06528%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.380	0.005	日経平均株価(終値)	20,026.38	136.11	為替(9時)	119.91-93
						為替(5時)	119.98-99

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	5/12	5/13	5/14	5/15	5/18	5/19
日銀当預残	2,080,200	2,115,300	2,078,400	2,098,200	2,082,800	2,118,200
準備預金残	1,895,300	1,926,600	1,889,600	1,908,700	1,896,200	1,927,100
レート	0.067%	0.068%	0.068%	0.070%	0.068%	0.069%
月中平均	0.06758%	0.06762%	0.06764%	0.06806%	0.06806%	0.06811%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入