

Central Daily Market Report

2020年5月12日(火)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2020年5月12日 需給速報	2020年5月13日 需給予想	2020年5月14日 当社予想
銀行券	1,700	800	1,000
財政	13,400	▲ 25,900	1,000
資金過不足	15,100	▲ 25,100	2,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		15,000	
国債買入	7,300		
CP等買入		▲ 500	▲ 200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			3,000
新型コロナ企業金融支援特別			
E T F 買入	800		
国債補充供給	▲ 200	800	200
※ドル資金供給用担保国債供給		▲ 1,000	
当預増減	23,300	▲ 11,100	5,000
当座預金残高	4,045,600	4,034,500	4,039,500
準備預金残高	3,499,000		
積み終了先	3,498,700		5月13日以降の残り所要積立額
超過準備	3,498,700		積数
非準備預金先	546,600		1日平均
			200
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額			3,220,500
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数
			90.00%

●2020年5月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.040~▲0.015%の出会いとなった。立ち上がりは▲0.020~▲0.015%中心であったものの、取りあがる動きは見られなかった。出会い一巡後は▲0.040%で調整の取りが見られた。ターム物に関しては特段の出会いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(5/13-5/14)は、▲0.14~▲0.095%程度での出会い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では2Y402~412、5Y136~143、10Y335~358、20Y167~172、30Y59~66、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペアが前回から10,000億円増額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差0.000%と、弱めな結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、償還総額750億円に対して、発行は少額の案件が中心で、発行総額は400億円程度であった。発行レートは、低位ながらも銘柄によりばらつきが見られ、ワイドなレンジとなった。

●短期金融市場関連指標

2020/5/12	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.102	▲ 0.010	▲ 0.015	20,366.48	▲ 24.18	107.59-60	107.55-57
T/N							-	▲ 0.133						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.115						
2W			0.001				-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.118						
1M							-	▲ 0.120						
3M			0.005				▲ 0.144	▲ 0.129						
6M							▲ 0.175	▲ 0.171						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.187						
									日付	4/30	5/1	5/7	5/8	5/11
									日銀当預残	4,122,000	4,090,600	4,048,500	4,063,700	4,022,300
									準備預金残	3,520,300	3,526,100	3,501,700	3,514,000	3,483,700
									マネタリーベース	5,291,600	5,261,500	5,216,600	5,229,800	5,186,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.060%	▲ 0.044%	▲ 0.035%	▲ 0.027%	▲ 0.019%
									コール市場残高	123,812	131,094	131,421	125,623	113,480
									うち無担	112,350	112,381	113,551	107,859	95,169
									うちO/N	69,911	69,692	68,177	63,705	52,535
									うち有担	11,462	18,713	17,870	17,764	18,311

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
10年利付国債	358	0.10%	21,000	2020/5/13	2030/3/20	69,360.0	16,961.0	100.9900	0.0000%	72.6710%	101.0000	▲0.0010%	4,031.0

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国庫短期証券買入	15,000	2020/5/13			33,491	15,001	0.000		0.007	58.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/5/12	2020/5/13	▲ 0.350	202	202		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/12	2020/5/13	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/14	2020/5/21	0.310	9,489	9,489				
米ドル資金供給		2020/5/14	2020/8/6	0.300	2,890	2,890				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/5/13	2020/8/7		977	977		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年5月13日の予定

*3月の国際収支	*英国1-3月期のGDP速報値	*交付税特別会計借入
*4月の景気ウォッチャー調査	*米国4月の生産者物価指数	(21,000億円、5/22借入)

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。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録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