

Central Daily Market Report

2020年5月13日(水)

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13日 需給速報	2020年5月14日 需給予想	2020年5月15日 当社予想
銀行券	800	400	1,000
財政	▲ 26,000	3,800	29,000
資金過不足	▲ 25,200	4,200	30,000
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		8,400	
CP等買入		▲ 200	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			400
社債等買入		3,000	▲ 300
新型コロナ企業金融支援特別			
E T F買入		1,200	
国債補充供給	▲ 100	200	100
米ドル資金供給(信用保証提供)	▲ 1,000		5,500
当預増減	▲ 11,300	16,700	35,600
当座預金残高	4,034,300	4,051,000	4,086,600
準備預金残高	3,494,600		
積み終了先	3,494,400		5月14日以降の残り所要積立額
超過準備	3,494,400		積数
非準備預金先	539,700		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	99.99%	日数
			93.33%

●2020年5月13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▲0.035~▲0.010%の出会いとなった。引き続きBIDサイドがしっかりしており昨日と概ね横ばい圏の▲0.025~▲0.010%で推移した。一巡後は調整から▲0.035~▲0.030%の出会い。ターム物に関してはショートタームで▲0.030~▲0.025%の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(5/14-5/15)は、▲0.12~▲0.09%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、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、償還が約4,000億円であったのに対して、発行は大型の案件が複数件実施されたことや、リファイナンスのニーズもあったため総額4,000億円強と同程度であった。発行レートは、条件による違いが少なく、落ち着いていた。本日はCP等買入オベが事前予定通り8,000億円で実施され、平均落札レート▲0.027%、按分落札レート▲0.068%という結果となった。

●短期金融市場関連指標

2020/5/13 単位：%	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	発表参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.099	▲ 0.005	0.005	20,267.05	▲ 99.43	107.17-19	107.05-06
T/N							-	▲ 0.107						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.110						
2W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.030				-	▲ 0.113						
3W							-	▲ 0.115						
1M							-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.144	▲ 0.127						
6M							▲ 0.175	▲ 0.169						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.187						
									日付	5/1	5/7	5/8	5/11	5/12
									日銀当預残	4,090,600	4,048,500	4,063,700	4,022,300	4,045,600
									準備預金残	3,526,100	3,501,700	3,514,000	3,483,700	3,499,000
									マネタリーベース	5,261,500	5,216,600	5,229,800	5,186,700	5,208,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.044%	▲ 0.035%	▲ 0.027%	▲ 0.019%	▲ 0.022%
									コール市場残高	131,094	131,421	125,623	113,480	125,745
									うち無担	112,381	113,551	107,859	95,169	106,955
									うちO/N	69,692	68,177	63,705	52,535	61,841
									うち有担	18,713	17,870	17,764	18,311	18,790

●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	業分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
交付税特会	-	-	21,000	2020/5/22	2020/11/19	291,670.0	20,990.14		0.0000%	7.4813%		0.0000%		10.0

●オベ結果

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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/5/14			8,652	3,402	▲0.004		▲0.002	76.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/5/14			8,704	3,505	0.003		0.004	95.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/5/14			3,850	1,205	0.003		0.004	61.1
CP等買入	8,000	2020/5/18			13,243	7,996	▲0.068		▲0.027	9.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/5/13	2020/5/14	▲ 0.350	70	70		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/13	2020/5/14	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/15	2020/5/22	0.310	0	0				
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
被災地金融支援オベ	第109回	2020/5/15	2021/5/14	0	60					
被災地金融支援オベ(熊本)	第48回	2020/5/15	2021/5/14	0	300					

●2020年5月14日の予定

*3月の特定サービス産業動態統計速報	*4月のマネーストック	*30年利付国債入札(7,000億円、5/15発行)
◆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		