Central Daily Market Report

2020年5月15日（金）
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15日 需給速報		2020年5月18日 需給予想		2020年5月19日 当社予想	
銀行券	1,000		1,300		1,000	
財政	38,900		▲ 25,700		▲ 36,000	
資金過不足	39,900		▲ 24,400		▲ 35,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,600			
CP等買入		▲ 700	8,000	▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	400	▲ 300				
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別	86,800					
ＥＴＦ買入	300		2,500			
国債補完供給	▲ 700	200		700		
＊ドル資金供給用担保国債供給		5,600				
当預増減	131,500		▲ 9,000		▲ 35,000	

当座預金残高	4,182,000	4,173,000	4,138,000
準備預金残高	3,629,700		
積み終了先	3,629,700		
超過準備	3,629,600		
非準備預金先	552,300		

5月18日以降の残り所要積立額	
積数	101,300
1日平均	3,500

積み期間（5/16～6/15）の所要準備額	3,360,900
準備預金進捗率　実績 96.99%	日数 6.45%

●2020年5月15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▲0.070～▲0.020%の出合いとなった。翌積み期間に係る最終日の取引となり、地銀業態中心に様子見の動きが見られたため、出合いレンジは弱含みで推移した。▲0.040～▲0.020%でまとまった出合いが見られた後、調整から▲0.070～▲0.060%の出合いが見られた。ターム物はショートタームで▲0.040%の出合い。

<レポ市場>

GC T/N(5/18-5/19)は、▲0.135～▲0.09%程度での出合い。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>

本日はTB3M物（907回）の入札が実施された。WI取引において▲0.127～▲0.117%での出合いが見られ、平均落札利回▲0.1154%、按分落札利回▲0.1102%と無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.127～▲0.117%出合いと堅調な推移となった。

<CP市場>

CP市場は、償還総額300億円強に対して、大型の調達が実施されたことで発行総額は1,500億円程度になった。発行レートは、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/5/15	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.040				－	▲ 0.096
T/N	▲ 0.087	▲ 0.080	▲ 0.082				－	▲ 0.092
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	0.200	0.009				－	▲ 0.096
2W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.038				－	▲ 0.100
3W							－	▲ 0.106
1M	▲ 0.060	▲ 0.045	▲ 0.053				－	▲ 0.112
3M							▲ 0.130	▲ 0.125
6M							▲ 0.166	▲ 0.169
1Y							▲ 0.170	▲ 0.183

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.007	0.003	20,037.47	122.69	107.35-36	107.09-10

日付	5/8	5/11	5/12	5/13	5/14
日銀当預残	4,063,700	4,022,300	4,045,600	4,034,300	4,050,500
準備預金残	3,514,000	3,483,700	3,499,000	3,494,600	3,513,800
マネタリーベース	5,229,800	5,186,700	5,208,300	5,196,100	5,212,000
無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.019%	▲0.022%	▲0.026%	▲0.020%
コール市場残高	125,623	113,480	125,745	128,520	127,342
うち無担	107,859	95,169	106,955	107,149	108,029
うちO/N	63,705	52,535	61,841	63,235	65,185
うち有担	17,764	18,311	18,790	21,371	19,313

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	907	－	72,400	2020/5/18	2020/8/17	212,984.0	58,736.3	100.0275	**▲0.1102%**	**68.3719%**	100.0288	**▲0.1154%**	13,663.0
国有林野借入	－	－	638	2020/5/25	2025/5/25	2,415.0	638.00		**0.0000%**	**50.0000%**		**0.0000%**	

●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
国債買入（残存期間1年以下）	800	2020/5/18			2,527	801	0.003		0.006	93.2
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,700	2020/5/18			8,169	3,708	0.001		0.002	68.3
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/5/15	2020/5/18	▲ 0.350	670	670		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/5/15	2020/5/18	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/19	2020/5/26	0.300	0	0				

●2020年5月18日の予定

*1-3月期のGDP1次速報（市場予想：前期比年率▲4.6%）
*3月の第3次産業活動指数
*5年利付国債入札（19,000億円、5/19発行）

◆本資料は信頼できると思わ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。
◆本資料は何ら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