

Central Daily Market Report

2020年5月18日(月)
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18日		2020年5月19日		2020年5月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100		800		0	
財政	▲ 24,700		▲ 33,600		20,000	
資金過不足	▲ 23,600		▲ 32,800		20,000	
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	8,000	▲ 400		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	2,500		100			
国債補充供給	▲ 1,000	700		1,000		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 9,200		▲ 32,000		20,000	
当座預金残高	4,172,800		4,140,800		4,160,800	
準備預金残高	3,598,300					
積み終了先	3,568,000				5月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,549,200				積数	52,100
非準備預金先	574,500				1日平均	1,900
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	98.45%	日数	9.68%		

●2020年5月18日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、立ち上がりは邦銀を中心に▲0.08～▲0.04%の出合い。新しい積み期間に入ったことで一部では様子見の動きも見られた。一巡後は▲0.08～▲0.06%程度で散発的な出合いが見られた程度であった。ターム物に関してはショートターム物で▲0.04%台の出合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/N(5/19-5/20)は、▲0.145～▲0.100%程度での出合い。SCはローラー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＞

アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.130%で出合った。

＜CP市場＞

発行市場は償還総額850億円程度に対して、発行総額は1,250億円程度と発行超であった。一部の建設・不動産業態において大型発行があったものの、多くは小型案件であったため落ち着いたマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/5/18	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	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.058				-	▲ 0.124	▲ 0.015	▲ 0.008	20,133.73	96.26	107.21-22	107.17-19
T/N	▲ 0.087	▲ 0.080	▲ 0.082				-	▲ 0.138						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.010	▲ 0.024				-	▲ 0.125						
2W	▲ 0.050	0.050	▲ 0.024				-	▲ 0.128						
3W							-	▲ 0.125						
1M	▲ 0.060	▲ 0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.124						
3M							▲ 0.130	▲ 0.131						
6M							▲ 0.165	▲ 0.169						
1Y							▲ 0.146	▲ 0.182						
									日付	5/11	5/12	5/13	5/14	5/15
									日銀当預残	4,022,300	4,045,600	4,034,300	4,050,500	4,182,000
									準備預金残	3,483,700	3,499,000	3,494,600	3,513,800	3,629,700
									マネタリーベース	5,186,700	5,208,300	5,196,100	5,212,000	5,342,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.022%	▲ 0.026%	▲ 0.020%	▲ 0.040%
									コール市場残高	113,480	125,745	128,520	127,342	127,737
									うち無担	95,169	106,955	107,149	108,029	109,241
									うちO/N	52,535	61,841	63,235	65,185	70,307
									うち有担	18,311	18,790	21,371	19,313	18,496

●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)
5年利付国債	143	0.10%	19,000	2020/5/19	2025/3/20	69,190.0	15,403.00	101.0700	▲0.1190%	49.2132%	101.0800	▲0.1220%	3,589.0

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/5/18	2020/5/19	▲ 0.350	962	962		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/18	2020/5/19	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/20	2020/5/27	0.300	118	118				

●2020年5月19日の予定

*米国4月の住宅着工件数

*国庫短期証券(908回)入札
(1年、25,000億円、5/20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