Central Daily Market Report

2020年5月19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19日 需給速報		2020年5月20日 需給予想		2020年5月21日 当社予想	
銀行券	800		300		0	
財政	▲ 35,000		33,000		▲ 16,000	
資金過不足	▲ 34,200		33,300		▲ 16,000	
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			7,900			
CP等買入		▲ 300		▲ 400		
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						
ＥＴＦ買入	100		900			
国債補完供給	▲ 300	1,000		300		
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 100			
当預増減	▲ 33,700		41,900		▲ 16,000	
当座預金残高	4,139,100		4,181,000		4,165,000	
準備預金残高	3,573,700					
積み終了先	3,561,900					
超過準備	3,554,100					
非準備預金先	565,400					
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	99.03%	日数	12.90%		

5月20日以降の残り所要積立額	
積数	32,500
1日平均	1,200

●2020年5月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.07～▲0.065%が出合いの中心レートとなった。調達の中心は邦銀で、積み期序盤という事もあって、取り急ぐ動きは見られなかった。一巡後は▲0.08～▲0.07%前後の出合いが見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。また、ショートターム物での運用意欲が高く複数のオファーが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(5/20-5/21)は、▲0.145～▲0.100%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TB1Y物（908回）の入札が実施された。WI取引において▲0.1625～▲0.160%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1657%、按分落札利回▲0.1607%としっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.1825～▲0.180% 出合いと堅調な推移となった。この他、3M物が▲0.1325%で出合った。

<CP市場>

発行市場は償還総額900億円程度に対して、発行総額は1,900億円程度と発行超であった。複数業態において大型案件が見られ、活況な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

2020/5/19	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.061				－	▲ 0.125
T/N	▲ 0.087	▲ 0.001	▲ 0.042				－	▲ 0.139
S/N							－	－
1W	▲ 0.050	▲ 0.010	▲ 0.037				－	▲ 0.128
2W			▲ 0.035				－	▲ 0.129
3W							－	▲ 0.127
1M			▲ 0.050				－	▲ 0.127
3M			0.035				▲ 0.131	▲ 0.131
6M							▲ 0.186	▲ 0.166
1Y							▲ 0.184	▲ 0.180

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）
0.000	0.015	20,433.45	299.72	107.38-39	107.41-42

日付	5/12	5/13	5/14	5/15	5/18
日銀当預残	4,045,600	4,034,300	4,050,500	4,182,000	4,172,800
準備預金残	3,499,000	3,494,600	3,513,800	3,629,700	3,597,700
マネタリーベース	5,208,300	5,196,100	5,212,000	5,342,500	5,332,200
無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.026%	▲0.020%	▲0.040%	▲0.058%
コール市場残高	125,745	128,520	127,342	127,737	129,629
うち無担	106,955	107,149	108,029	109,241	113,323
うちO/N	61,841	63,235	65,185	70,307	69,164
うち有担	18,790	21,371	19,313	18,496	16,306

●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	908	－	25,000	2020/5/20	2021/5/20	92,973.0	20,290.7	100.1610	**▲0.1607%**	**9.8577%**	100.1660	**▲0.1657%**	4,709.0

●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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,400	2020/5/20			8,983	3,401	0.014		0.016	90.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,700	2020/5/20			6,490	3,714	0.016		0.017	64.2
国債買入（残存期間25年超）	300	2020/5/20			896	304	0.011		0.012	97.7
国債買入（物価連動債）	300	2020/5/20			1,110	302	▲0.250		▲0.290	100.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/5/19	2020/5/20	▲ 0.350	222	222		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/5/19	2020/5/20	▲ 0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/5/21	2020/5/28	0.310	9,292	9,292				
米ドル資金供給		2020/5/21	2020/8/13	0.310	2,373	2,373				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2020/5/20	2020/5/29		2	2		▲0.100	▲0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2020/5/20	2020/8/14		68	68		▲0.100	▲0.100	

●2020年5月20日の予定

*3月の機械受注統計
（市場予想：
船舶・電力除く民需、前月比▲7.1%）

*ユーロ圏4月の消費者物価指数改定値
*英国4月の消費者物価指数

*20年利付国債入札
（9,000億円、5/21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