

# Central Daily Market Report

2020年5月20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20日		2020年5月21日		2020年5月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200	▲ 300				0
財政	33,400	▲ 14,100				▲ 6,000
資金過不足	33,600	▲ 14,400				▲ 6,000
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		▲ 400		▲ 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				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	900					
国債補完供給	▲ 100	300		100		
米ドル資金供給用担保貸付供給	▲ 100					
当増増減	42,100		▲ 14,600			▲ 6,000
当座預金残高	4,181,200		4,166,600			4,160,600
準備預金残高	3,578,300					
積み終了先	3,572,100				5月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,569,300				積数	23,500
非準備預金先	602,900				1日平均	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	99.30%	日数	16.13%		

## ●2020年5月20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▲0.07～▲0.065%での調達で始まった。昨日に続き調達レートは低下傾向で、一巡後は▲0.08～▲0.07%近辺の出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。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＞

GCT/N(5/21-5/22)は、▲0.135～▲0.095%程度での出合い。SCI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＞

アウトライト市場は、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.190%で出合った。

### ＜CP市場＞

発行市場は償還総額1,300億円程度に対して、発行総額は2,500億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

2020/5/20	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.061				-	▲ 0.104	0.000	0.000	20,595.15	161.70	107.81-83	107.65-66
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.115						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.118						
2W	▲ 0.030	0.310	0.048				-	▲ 0.121						
3W							-	▲ 0.122						
1M			▲ 0.048				-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.132	▲ 0.129						
6M							▲ 0.186	▲ 0.168						
1Y							▲ 0.192	▲ 0.181						
									日付	5/13	5/14	5/15	5/18	5/19
									日銀当預残	4,034,300	4,050,500	4,182,000	4,172,800	4,139,100
									準備預金残	3,494,600	3,513,800	3,629,700	3,597,700	3,573,700
									マネタリーベース	5,196,100	5,212,000	5,342,500	5,332,200	5,297,800
									無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.020%	▲0.040%	▲0.058%	▲0.061%
									コール市場残高	128,520	127,342	127,737	129,629	132,639
									うち無担	107,149	108,029	109,241	113,323	115,269
									うちO/N	63,235	65,185	70,307	69,164	68,130
									うち有担	21,371	19,313	18,496	16,306	17,370

## ●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)
20年利付国債	172	0.40%	9,000	2020/5/21	2040/3/20	31,089.0	7,321.0	101.2000	0.3350%	36.3983%	101.2600	0.3320%	1,670.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/5/20	2020/5/21	▲ 0.350	105	105		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/20	2020/5/21	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/22	2020/5/29	0.310	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	2,000	2020/5/26			5,920	2,001	0.170		0.212	31.6

## ●2020年5月21日の予定

*4月の貿易統計	*米国4月の中古住宅販売	*交付税特別会計借入(21,000億円、5/29借入)
----------	--------------	-----------------------------

◆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