

# Central Daily Market Report

2020年5月14日(木)

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14日 需給速報	2020年5月15日 需給予想	2020年5月18日 当社予想
銀行券	400	900	1,000
財政	3,500	37,500	▲18,000
資金過不足	3,900	38,400	▲17,000
<b>金融調節</b>			
	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			
国債買入	8,400		
CP等買入		▲200	▲700
貸出支援基金(成)			8,000
貸出支援基金(貸)			
被災地支援		400	▲300
社債等買入	3,000		
新型コロナ対応金融支援特別		86,800	
E T F 買入	1,200		300
国債補充供給	▲200	100	200
※ドル資金供給用担保提供供給			5,600
当預増減	16,200	130,700	▲9,000
当座預金残高	4,050,500	4,181,200	4,172,200
準備預金残高	3,513,800		
積み終了先	3,513,600		5月15日以降の残り所要積立額
超過準備	3,513,600		積数
非準備預金先	536,700		1日平均
			100
			100
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	100.00%	日数
			96.67%

## ●2020年5月14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。引き続き都銀・信託業態の調達ニーズが強いことに加え、積み最終の調整から地銀業態でも積極的な調達が見られ、前日比でレートは上昇した。ターム物に関してはショートタームで▲0.03%台での出会いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(5/15-5/18)は、▲0.125~▲0.095%程度での出会い。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>

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500億円であったのに対して、発行は少額の案件が中心で総額500億円弱と同程度であった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/5/14	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲0.060	0.001	▲0.020				-	▲0.100	▲0.010	▲0.005	19,914.78	▲352.27	106.92-94	106.86-87
T/N							-	▲0.121						
S/N							-	-						
1W	▲0.037	▲0.020	▲0.027				-	▲0.110						
2W			▲0.035				-	▲0.111						
3W							-	▲0.115						
1M	▲0.030	▲0.020	▲0.026				-	▲0.120						
3M							▲0.140	▲0.128						
6M							▲0.175	▲0.172						
1Y							▲0.200	▲0.187						
									日付	5/7	5/8	5/11	5/12	5/13
									日銀当預残	4,048,500	4,063,700	4,022,300	4,045,600	4,034,300
									準備預金残	3,501,700	3,514,000	3,483,700	3,499,000	3,494,600
									マネタリーベース	5,216,600	5,229,800	5,186,700	5,208,300	5,196,100
									無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.027%	▲0.019%	▲0.022%	▲0.026%
									コール市場残高	131,421	125,623	113,480	125,745	128,520
									うち無担	113,551	107,859	95,169	106,955	107,149
									うちO/N	68,177	63,705	52,535	61,841	63,235
									うち有担	17,870	17,764	18,311	18,790	21,371

## ●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)
30年利付国債	66	0.40%	7,000	2020/5/15	2050/3/20	20,857.0	5,655.0	98.6000	0.4530%	65.4037%	98.6900	0.4490%	1,335.0

## ●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)		2020/5/14	2020/5/15	▲0.350	194	194		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/14	2020/5/15	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/18	2020/5/26	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)
新型コロナ対応金融支援特別	第4回	2020/5/15	2020/8/14	0
				86,839

## ●2020年5月15日の予定

*4月の企業物価指数	*米国3月の企業在庫	*国庫短期証券(907回)入札(3ヶ月、72,400億円、5/18発行)
	*米国4月の小売売上高	*国有林野借入(638億円、5/25借入)
	*米国4月の鉱工業生産・設備稼働率	
	*米国5月のミシガン大消費者信頼感指数速報	
	*ユーロ圏GDP1-3月期改定値	

◆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