

Central Daily Market Report

2020年5月1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1日 需給速報	2020年5月7日 需給予想	2020年5月8日 当社予想
銀行券	▲ 1,300	3,600	2,000
財政	▲ 30,300	▲ 53,700	5,000
資金過不足	▲ 31,600	▲ 50,100	7,000
金融調節			
	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			
CP等買入		▲ 100	▲ 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			
新型コロナ企業金融支援特別			
E T F 買入			1,300
国債補完供給	▲ 1,700	2,000	1,700
※ドル資金供給用担保債供給			
当預増減	▲ 31,400	▲ 47,300	7,000
当座預金残高	4,090,600	4,043,300	4,050,300
準備預金残高	3,526,100		
積み終了先	3,525,900		5月7日以降の残り所要積立額
超過準備	3,525,600		積数 1,600
非準備預金先	564,500		1日平均 200
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額			3,209,400
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数 70.00%

●2020年5月1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~▲0.025%の出合いが中心となった。月末要因の剥落から取り手が増加し、連休挟みの取引となり、大手行中心に積極的な資金調達姿勢が見られ、前日対比で上昇した。ターム物に関してはショートタームで▲0.040~▲0.035%の出合い。

<レポ市場>

GC T/N(5/7-5/8)は、▲0.080~▲0.050%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2Y402~411、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(904回)入札が実施された。WI取引において▲0.105~▲0.1025%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1061%、按分落札利回▲0.0995%となった。発行額が72,400億円(前回57,400億円)に増額されたことや、今後の増発傾向を鑑みると、しっかりした結果であった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.130~▲0.125%出合いと堅調な推移となった。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額800億円弱に対して、発行総額は100億円程度にとどまる閑散なマーケットとなった。発行レートは引き続き低下基調となっている。

●短期金融市場関連指標

2020/5/1	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	発表参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.061	▲ 0.030	0.012	19,619.35	▲ 574.34	107.27-29	106.93-96
T/N							-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.077						
2W	▲ 0.040	0.310	▲ 0.016				-	▲ 0.080						
3W							-	▲ 0.089						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.130	▲ 0.131						
6M							▲ 0.145	▲ 0.174						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.190						
									日付	4/23	4/24	4/27	4/28	4/30
									日銀当預残	4,097,200	4,110,200	4,107,100	4,109,300	4,122,000
									準備預金残	3,538,500	3,552,700	3,562,300	3,536,100	3,520,300
									マネタリーベース	5,256,000	5,270,900	5,269,800	5,275,200	5,291,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.047%	▲ 0.047%	▲ 0.048%	▲ 0.060%
									コール市場残高	124,700	121,854	124,853	122,113	123,812
									うち無担	108,683	106,740	105,822	109,417	112,350
									うちO/N	70,695	68,812	68,249	68,459	69,911
									うち有担	16,017	15,114	19,031	12,696	11,462

●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)
国庫短期証券	904	-	72,400	2020/5/7	2020/8/3	227,468.5	58,964.7	100.0240	▲0.0995%	25.9223%	100.0256	▲0.1061%	13,435.0
流動性供給	309	-	4,000	2020/5/7		13,153.0	3,994.0		0.0180%	53.3163%		0.0140%	
交付税特会	-	-	11,000	2020/5/15	2020/11/13	231,597.0	11,000.00		0.0000%	4.7497%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/5/1	2020/5/7	▲ 0.350	1,688	1,688		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/1	2020/5/7	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/7	2020/5/14	0.290	0	0				

●2020年5月4日の予定

*みどりの日
*米国3月の製造業新規受注・出荷・在庫

●2020年5月5日の予定

*こどもの日
*米国3月の貿易収支
*米国4月のISM非製造業景況指数

●2020年5月6日の予定

*振替休日
*国庫短期証券(905回)入札(6ヶ月、25,000億円、5/11発行)

●2020年5月7日の予定

*4月実績/5月見込み財政資金対民間収支
*金融政策決定会合議事要旨(3月16日分)
*4月のマネタリーベース
*英中銀MPC結果発表
*米国3月の消費者信用残高

◆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