

Central Daily Market Report

2020年5月7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7日 需給速報	2020年5月8日 需給予想	2020年5月11日 当社予想
銀行券	2,800	2,100	2,000
財政	▲ 44,600	3,000	▲ 58,000
資金過不足	▲ 41,800	5,100	▲ 56,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 13,400
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		8,100	
CP等買入		▲ 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			
新型コロナウイルス企業金融支援特別			
ETF買入	1,300	800	
国債補完供給	▲ 3,100	1,700	3,100
米ドル資金供給用担保提供			
当預増減	▲ 42,100	17,100	▲ 69,400
当座預金残高			
準備預金残高	4,048,500	4,065,600	3,996,200
準備預金残高	3,501,700		
積み終了先	3,501,500		5月8日以降の残り所要積立額
超過準備	3,501,500		積数 1,400
非準備預金先	546,800		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 99.96%	日数 73.33%	

●2020年5月7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▲0.080~▲0.020%の出会いとなった。立ち上がりは様子見姿勢であったものの、▲0.040%で寄り付き後、ビッドサイドがしっかり並び▲0.040~▲0.020%程度が中心となった。一巡後は調整から▲0.080%の出会い。ターム物に関してはショートタームで▲0.030%の出会い。

<レポ市場>

GC T/N(5/8-5/11)は、▲0.100~▲0.080%程度での出会い。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6M物(905回)入札が実施された。WI取引において▲0.125%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1474%、按分落札利回▲0.1435%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、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、償還1,400億円に対し、発行総額が1,200億円となった。複数の発行体から調達を実施された。発行レートは、引き続き銘柄による差異があるものの、全体的に低下傾向となっている。

●短期金融市場関連指標

2020/5/7	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.065	▲ 0.005	0.025	19,674.77	55.42	106.21-22	106.35-36	
T/N							-	▲ 0.077							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.028				-	▲ 0.082							
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.085							
3W							-	▲ 0.090							
1M	▲ 0.001	0.010	0.005				-	▲ 0.100							
3M							▲ 0.145	▲ 0.122							
6M							▲ 0.170	▲ 0.169							
1Y							▲ 0.200	▲ 0.188							
										日付	4/24	4/27	4/28	4/30	5/1
										日銀当預残	4,110,200	4,107,100	4,109,300	4,122,000	4,090,600
										準備預金残	3,552,700	3,562,300	3,536,100	3,520,300	3,526,100
										マネタリーベース	5,270,900	5,269,800	5,275,200	5,291,600	5,261,500
										無担O/N加重平均	▲ 0.047%	▲ 0.047%	▲ 0.048%	▲ 0.060%	▲ 0.044%
										コール市場残高	121,854	124,853	122,113	123,812	131,094
										うち無担	106,740	105,822	109,417	112,350	112,381
										うちO/N	68,812	68,249	68,459	69,911	69,692
										うち有担	15,114	19,031	12,696	11,462	18,713

●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	905	-	25,000	2020/5/11	2020/11/10	123,445.0	20,326.9	100.0720	▲0.1435%	45.4258%	100.0740	▲0.1474%	4,673.0

●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年以下)	800	2020/5/8			2,362	801	0.008		0.011	71.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/5/8			6,864	3,404	0.010		0.014	43.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,700	2020/5/8			12,698	3,711	0.018		0.019	33.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/5/7	2020/5/8	▲ 0.350	3,003	3,003		▲ 0.350	▲ 0.357	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/7	2020/5/8	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/11	2020/5/18	0.300	400	400				

●2020年5月8日の予定

- | | | |
|-------------------------------------|--------------------|--|
| *3月の全世帯家計調査
(市場予想：消費支出、前年比▲6.7%) | *London祝日(May Day) | *国庫短期証券(906回)入札
(3ヶ月、72,400億円、5/11発行) |
| *3月の毎月勤労統計調査速報 | *米国3月の卸売売上高 | *10年物価連動国債入札(2,000億円、5/11発行) |
| *5月の日銀当座預金増減要因見込み | *米国4月の雇用統計 | *エネルギー対策借入(8,000億円、5/20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