

Central Daily Market Report

2020年5月21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21日		2020年5月22日		2020年5月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 200		1,000	
財政	▲ 13,700		32,700		▲ 28,000	
資金過不足	▲ 14,100		32,500		▲ 27,000	
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						▲ 8,500
国債売現						
国債買現						
国庫短期証券買入			15,000			
国債買入			7,800			
CP等買入		▲ 200		▲ 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			1,700			
国債補充供給		100				
米ドル資金供給(国債消費供給)						
当増減	▲ 14,300		56,800		▲ 35,500	
当座預金残高	4,166,900		4,223,700		4,188,200	
準備預金残高	3,590,300					
積み終了先	3,587,200				5月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,586,500				積数	19,600
非準備預金先	576,600				1日平均	800
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	99.42%	日数	19.35%		

●2020年5月21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%での調達で始まり、昨日対比で横ばい圏の動きとなった。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。引き続き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(5/22-5/25)は、▲0.12~▲0.09%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>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペアが前回と同額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差+0.001%と、ややしっかりした結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.195%で出合った。

<CP市場>

発行市場は償還総額850億円程度に対して、発行総額は2,400億円程度と発行超であった。5・10日発行となり鉄鋼・パルプ業態において大型案件が見られ、活況なマーケットとなった。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

2020/5/21	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	▲ 0.062				-	▲ 0.101	▲ 0.005	▲ 0.005	20,552.31	▲ 42.84	107.59-60	107.77-78
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.010	▲ 0.035				-	▲ 0.115						
2W							-	▲ 0.118						
3W							-	▲ 0.120						
1M	▲ 0.065	▲ 0.050	▲ 0.062				-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.133	▲ 0.129						
6M							▲ 0.186	▲ 0.168						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.182						

●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非償格募入札(億円)	非償格入札(億円)
交付税特会	-	-	21,000	2020/5/29	2020/11/30	273,911.0	20,990.16		0.0000%	7.8348%		0.0000%		10.0

●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
国庫短期証券買入	15,000	2020/5/22			25,443	15,002	0.001		0.007	77.5
国債買入(残存期間1年以下)	800	2020/5/22			2,070	801	0.003		0.004	61.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/5/22			7,971	3,402	▲0.013		▲0.009	18.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/5/22			6,501	3,504	▲0.010		▲0.008	57.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/5/21	2020/5/22	▲ 0.350	8	8		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/21	2020/5/22	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/26	2020/6/2	0.300	0	0				

●2020年5月22日の予定

*臨時の日銀金融政策決定会合 *4月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)▲0.1%	*国庫短期証券(909回)入札 (3ヶ月、81,400億円、5/25発行)	*流動性供給入札 (5,000億円、5/25発行)
---	--	------------------------------

◆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