

# Central Daily Market Report

2020年5月26日(火)

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26日		2020年5月27日		2020年5月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 600		0	
財政	14,500		▲ 1,800		1,000	
資金過不足	13,700		▲ 2,400		1,000	
<b>金融調節</b>	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			20,000			
国債買入	11,100					
CP等買入		▲ 800		▲ 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	2,000 ▲ 300					
新型コロナ対応金融支援特別			17,300			
ETF買入	300					
国債補完供給	▲ 200		300		200	
米ドル資金供給用担保確保供給						
<b>当増減</b>	26,100		34,900		1,000	
当座預金残高	4,206,800		4,241,700		4,242,700	
準備預金残高	3,628,600					
積み終了先	3,627,000		5月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,627,000		積数		7,600	
非準備預金先	578,200		1日平均		400	
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	99.77%	日数	35.48%		

## ●2020年5月26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~▲0.06%近辺の調達で始まった。引き続き調達ニーズが弱い状況に変化はなく、一巡後は▲0.08%近辺の出会いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物はロール案件中心で散発的に出会いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(5/27-5/28)は、▲0.105~▲0.08%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2Y402~412、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、短国買入オベが前回から5,000億円増額の20,000億円度でオファーされた。平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差0.000%と、オファー額が多かったにしては、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▲0.198%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は機械・繊維業態から大型の発行が実施された。償還総額2,700億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と償還超であった。発行レートは引き続きマイナス圏で推移した。今日はCP等買入オベが事前予定通り8,000億円で実施され、平均落札レート▲0.020%、按分落札レート▲0.027%と、前回(平均▲0.027%、按分▲0.068%)比で平均・按分ともに上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/5/26	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	▲ 0.060				-	▲ 0.081	0.000	0.000	21,271.17	529.52	107.68-70	107.82-83		
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.092								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.070	0.010	▲ 0.041				-	▲ 0.095								
2W			▲ 0.065				-	▲ 0.097								
3W							-	▲ 0.104								
1M	▲ 0.060	▲ 0.050	▲ 0.053				-	▲ 0.109								
3M							-	▲ 0.117								
6M							-	▲ 0.200								
1Y							-	▲ 0.187								
											日付	5/19	5/20	5/21	5/22	5/25
											日銀当預残	4,139,100	4,181,200	4,166,900	4,223,200	4,180,700
											準備預金残	3,573,700	3,578,300	3,588,900	3,639,900	3,603,800
											マネタリーベース	5,297,800	5,339,600	5,325,700	5,382,200	5,339,800
											無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.061%	▲0.062%	▲0.059%	▲0.059%
											コール市場残高	132,639	134,638	131,713	134,565	136,954
											うち無担	115,269	115,375	111,576	115,475	116,885
											うちO/N	68,130	66,256	68,277	70,076	70,456
											うち有担	17,370	19,263	20,137	19,090	20,069

## ●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I非面格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
40年利付国債	13	0.50%	5,000	2020/5/27	2060/3/20	15,273.0	4,995.0		0.5050%	93.4959%				
交付税特会	-	-	21,000	2020/6/3	2020/12/3	287,033.0	20,990.11		0.0000%	7.3384%		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	20,000	2020/5/27			41,709	20,004	0.000		0.003	35.2
CP等買入	8,000	2020/5/29			19,452	8,000	▲0.027		▲0.020	87.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/5/26	2020/5/27	▲0.350	141	141		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/5/26	2020/5/27	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/28	2020/6/4	0.300	5,250	5,250				
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5回	2020/5/27	2020/8/27	0	17,292					

## ●2020年5月27日の予定

\*米国ページュブック

\*国庫短期証券(910回)入札(6ヶ月、25,000億円、6/1発行)

◆本資料は信頼できるとおぼやか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