

Central Daily Market Report

2020年5月28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28日 需給速報	2020年5月29日 需給予想	2020年6月1日 当社予想
銀行券	▲ 1,500	▲ 900	1,000
財政	13,000	14,100	▲ 71,000
資金過不足	11,500	13,200	▲ 70,000
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		▲ 600	8,000 ▲ 2,100
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	600		
国債補充供給	▲ 300		300
米ドル資金供給用担保提供供給	▲ 1,000		
当預増減	10,100	19,400	▲ 70,000
当座預金残高	4,252,100	4,271,500	4,201,500
準備預金残高	3,660,100		
積み終了先	3,659,400		5月29日以降の残り所要積立額
超過準備	3,658,900		積数 5,000
非準備預金先	592,000		1日平均 300
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	99.85%	日数 41.94%

●2020年5月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀を中心に▲0.07~▲0.05%近辺の調達で始まった。資金調達意欲は引き続き弱く、一巡後は▲0.08~▲0.07%前後の出合いが見られた。ターム物に関しては、特段出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(5/29-6/1)は、▲0.125~▲0.095%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、動意なく閑散な中、6M物が▲0.195~▲0.194%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は鉄鋼業態からまとまった発行が実施された。償還総額100億円程度に対して、発行総額は600億円程度と発行超であった。発行レートは引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/5/28	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	▲ 0.057				-	▲ 0.110	▲ 0.005	▲ 0.002	21,916.31	497.08	107.80-82	107.82-83
T/N	▲ 0.150	▲ 0.080	▲ 0.114				-	▲ 0.113						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.080	▲ 0.065	▲ 0.076				-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.070				-	▲ 0.104						
3W			▲ 0.075				-	▲ 0.105						
1M	▲ 0.065	0.060	▲ 0.023				-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.119	▲ 0.124						
6M							▲ 0.195	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.187						
									日付	5/21	5/22	5/25	5/26	5/27
									日銀当預残	4,166,900	4,223,200	4,180,700	4,206,800	4,242,000
									準備預金残	3,588,900	3,639,900	3,603,800	3,628,600	3,648,500
									マネタリーベース	5,325,700	5,382,200	5,339,800	5,366,700	5,402,500
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.059%	▲0.059%	▲0.060%	▲0.059%
									コール市場残高	131,713	134,565	136,954	137,582	143,574
									うち無担	111,576	115,475	116,885	119,629	122,911
									うちO/N	68,277	70,076	70,456	72,680	74,652
									うち有担	20,137	19,090	20,069	17,953	20,663

●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	募入最高利率・利回差	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
2年利付国債	413	0.10%	20,000	2020/6/1	2022/6/1	85,506.0	16,205.0	100.5400	▲0.1690%	11.6467%	100.5460	▲0.1720%	3,780.0

●オペ結果

種類	オフターム (億円・百万円)	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付総額 (億円・百万円)	貸付総額 (億円・百万円)	貸付総額 (億円・百万円)	貸付総額 (億円・百万円)	貸付総額 (億円・百万円)	貸付総額 (億円・百万円)	貸付総額 (億円・百万円)	貸付総額 (億円・百万円)	貸付総額 (億円・百万円)
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフターム)		2020/5/28	2020/5/29	▲ 0.350	321	321				▲ 0.350	▲ 0.350		
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフターム)		2020/5/28	2020/5/29	▲ 0.350	0	0							
米ドル資金供給		2020/6/1	2020/6/8	0.300	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・百万円)	貸付先数
成長基盤強化	本則第40回	2020/6/3	0	1,950	25
成長基盤強化	米ドル特別第32期	2020/6/4		108	22
成長基盤強化	米ドル特別第28期(借り換え)	2020/6/4		707	18
成長基盤強化	米ドル特別第24期(借り換え)	2020/6/4		1,396	18
成長基盤強化	米ドル特別第20期(借り換え)	2020/6/4		3,626	29

●2020年5月29日の予定

*4月の完全失業率(市場予想: 2.7%)	*4月の有効求人倍率(市場予想: 1.33倍)	*米国4月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(911回)入札
*5月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想: 前年同月比(除く生鮮)▲0.2%)	*米国5月のシカゴPM景況感指数		(3ヶ月、81,400億円、6/1発行)
*4月の商業動態統計速報	*ユーロ圏5月の消費者物価指数		
*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想: 前月比▲5.1%)			
*5月の消費動向調査	*4月の住宅着工統計		

◆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