

Central Daily Market Report

2021年5月26日(水)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2021年5月26日		2021年5月27日		2021年5月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	3,700		▲ 10,800		▲ 3,000	
資金過不足	2,900		▲ 11,900		▲ 4,000	
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	3,400	▲ 2,900				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	400		100		
<small>*ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	3,600		▲ 6,900		▲ 4,000	
当座預金残高	5,295,900		5,289,000		5,285,000	
準備預金残高	4,624,600					
積み終了先	4,624,300		5月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,624,300		積数		2,700	
非準備預金先	671,300		1日平均		100	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,743,300	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	35.48%		

●2021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、邦銀業態を中心に▲0.030~▲0.008%での調達で始まった。調達サイドから僅かにレートを引き下げる動きが見られたものの、全体的な出会い水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は▲0.025~▲0.003%程度での出会いで推移した。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GCT/N(5/27-5/28)は、▲0.14~▲0.105%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2Y410~424、5Y140~147、10Y345~362、20Y170~176、30Y59~70、40Y10~13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、短国買入オペが前回から5,000億円減額の5,000億円でオファーされ、平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.003%と、しっかりとした結果となった。マーケットは動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP市場は、償還が1,800億円程度に対して、発行は大型案件が複数実施されたことで2,800億円強と発行超であった。発行レートは、期越えの希少銘柄には積極的な応札が見られていた。CP等買入オペは、4,000億円のオファーに対して、按分レート▲0.010%、平均落札レート▲0.006%といずれも前回から上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2021/5/26	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)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.101	0.070	0.000	28,642.19	88.21	108.79-80	108.83-84
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.117						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.006	▲ 0.010				-	▲ 0.106						
2W	▲ 0.010	0.030	▲ 0.002				-	▲ 0.105						
3W	▲ 0.008	0.150	0.017				-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.106						
3M			0.005				▲ 0.135	▲ 0.110						
6M							▲ 0.110	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	5/19	5/20	5/21	5/24	5/25
									日銀当預残	5,288,900	5,256,200	5,267,000	5,267,500	5,292,300
									準備預金残	4,635,000	4,606,400	4,618,000	4,601,500	4,617,500
									マネタリーベース	6,497,500	6,464,800	6,475,600	6,476,100	6,500,900
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.015%	▲0.014%	▲0.015%	▲0.016%
									コール市場残高	162,379	164,423	169,392	165,754	164,730
									うち無担	143,637	144,552	147,972	144,010	144,610
									うちO/N	84,879	83,264	85,944	82,242	81,232
									うち有担	18,742	19,871	21,420	21,744	20,120

●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	業分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	5,000	2021/5/27			15,338	5,004	▲0.003		▲0.001	9.4
CP等買入	4,000	2021/5/31			9,656	3,975	▲0.010		▲0.006	24.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/26	2021/5/27	▲ 0.350	139	139		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/26	2021/5/27	▲ 0.350	0	0				

●2021年5月27日の予定

*米国1-3月期のGDP改定値	*40年利付国債入札
*米国4月の耐久財新規受注	(6,000億円、5/28発行)

◆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