

Central Daily Market Report

2021年5月27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	2021年5月27日		2021年5月28日		2021年5月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 100			400
財政	▲ 14,800		4,200			▲ 5,700
資金過不足	▲ 15,900		4,100			▲ 5,300
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						
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		▲ 400		4,000
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			400			
国債補完供給		100				
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 10,900		4,100			▲ 1,300
当座預金残高	5,285,000		5,289,100			5,287,800
準備預金残高	4,611,700					
積み終了先	4,611,400				5月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,611,400				積数	2,300
非準備預金先	673,300				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	99.94%	日数	38.71%		

●短期金融市場関連指標

2021/5/27	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.103	0.070	0.000	28,549.01	▲ 93.18	109.17-18	109.09-11
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.110						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.012				-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.020	▲ 0.009	▲ 0.017				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.105						
1M	▲ 0.013	▲ 0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.135	▲ 0.109						
6M							▲ 0.110	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	5/20	5/21	5/24	5/25	5/26
									日銀当預残	5,256,200	5,267,000	5,267,500	5,292,300	5,295,900
									準備預金残	4,606,400	4,618,000	4,601,500	4,617,500	4,624,600
									マネタリーベース	6,464,800	6,475,600	6,476,100	6,500,900	6,505,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.015%	▲ 0.014%	▲ 0.015%	▲ 0.016%	▲ 0.018%
									コール市場残高	164,423	169,392	165,754	164,730	163,379
									うち無担	144,552	147,972	144,010	144,610	143,867
									うちO/N	83,264	85,944	82,242	81,232	81,469
									うち有担	19,871	21,420	21,744	20,120	19,512

●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)
40年利付国債	14	0.70%	6,000	2021/5/28	2061/3/20	16,792.0	5,993.0	99.6500	0.7100%	68.2525%			

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/27	2021/5/28	▲ 0.350	9	9		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/27	2021/5/28	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	本則第44回	2021/6/2		0	2,644
成長基盤強化	米ドル特別第36期	2021/6/4			3,387
成長基盤強化	米ドル特別第32期(借り換え)	2021/6/4			90
成長基盤強化	米ドル特別第28期(借り換え)	2021/6/4			444
成長基盤強化	米ドル特別第24期(借り換え)	2021/6/4			1,188

●2021年5月28日の予定

*4月の完全失業率(市場予想：2.7%)	*米国4月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(997回)入札
*4月の有効求人倍率(市場予想：1.1倍)	*米国5月のシカゴPM景況感指数	(3ヶ月、63,000億円、5/31発行)
*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%		

◆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