

Central Daily Market Report

2021年5月28日(金)

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28日		2021年5月31日		2021年6月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		700		1,000	
財政	8,000		▲ 7,900		▲ 36,000	
資金過不足	7,900		▲ 7,200		▲ 35,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,400			
CP等買入		▲ 400	4,000	▲ 3,800		
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					
国債補充供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	7,700		4,600		▲ 35,000	
当座預金残高	5,292,700		5,297,300		5,262,300	
準備預金残高	4,619,000					
積み終了先	4,618,600				5月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,618,600				積数	1,300
非準備預金先	673,700				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	99.97%	日数	48.39%		

●2021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物は、地銀業態を中心に、調達を控える先やレートを引き下げる先が見受けられ、前日比でレートは低下した。立ち上がりは邦銀、証券業態などから▲0.035~▲0.008%程度の出合いが見られた。一巡後は▲0.040~▲0.006%のレンジの出合いで推移した。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>

GC T/N(5/31-6/1)は、▲0.10~▲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>

本日はTB3M物(997回)の入札が実施され、WI取引において▲0.116~▲0.113%とやや強めの出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1122%、按分落札利回▲0.1062%と無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.109~▲0.108%出合いと、やや軟調に推移した。この他に、6M物が▲0.112%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、大型案件が実施されたことで発行額は1,500億円となった。発行レートは、期越えの希少銘柄に対するニーズが引き続き堅調であった。

●短期金融市場関連指標

2021/5/28	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	▲ 0.025				-	▲ 0.093	0.080	0.010	29,149.41	600.40	109.81-82	109.88-89
T/N	▲ 0.018	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.100						
S/N			▲ 0.013				-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.019				-	▲ 0.102						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.103						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.108	▲ 0.109						
6M							▲ 0.112	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	5/21	5/24	5/25	5/26	5/27
									日銀当預残	5,267,000	5,267,500	5,292,300	5,295,900	5,285,000
									準備預金残	4,618,000	4,601,500	4,617,500	4,624,600	4,611,700
									マネタリーベース	6,475,600	6,476,100	6,500,900	6,505,300	6,495,500
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.018%	▲0.021%
									コール市場残高	169,392	165,754	164,730	163,379	163,114
									うち無担	147,972	144,010	144,610	143,867	141,534
									うちO/N	85,944	82,242	81,232	81,469	79,836
									うち有担	21,420	21,744	20,120	19,512	21,580

●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)
国庫短期証券	997	-	63,000	2021/5/31	2021/8/30	182,204.0	51,438.3	100.2650	▲0.1062%	17.6715%	100.0280	▲0.1122%	11,561.0

●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	実行利率	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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2021/5/31			2,878	1,501	▲0.005		0.000	5.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/5/31			13,469	4,505	0.006		0.007	38.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/5/31			10,392	4,510	0.009		0.010	37.3
国債買入(物価連動債)	600	2021/5/31			2,783	600	▲0.190		▲0.289	56.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/28	2021/5/31	▲0.350	234	234		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/28	2021/5/31	▲0.350	0	0				

●2021年5月31日の予定

*4月の商業動態統計速報	*New York祝日(Memorial Day)	*2年利付国債入札(30,000億円、6/1発行)
*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報	*London祝日(Spring Bank Holiday)	
市場予想：前月比+4.1%		
*5月の消費動向調査		

◆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