Central Daily Market Report

2020年5月27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	2020年5月27日 需給速報		2020年5月28日 需給予想		2020年5月29日 当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,500		600	
財政	▲ 1,500		14,900		▲ 2,100	
資金過不足	▲ 2,100		13,400		▲ 1,500	
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	20,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 600	8,000	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別	17,300					
ＥＴＦ買入			600			
国債補完供給		200				
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 1,000			
当預増減	35,200		12,300		6,500	

当座預金残高	4,242,000	4,254,300	4,260,800
準備預金残高	3,648,500		
積み終了先	3,647,200		
超過準備	3,647,200		
非準備預金先	593,500		

5月28日以降の残り所要積立額	
積数	6,200
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	99.82%	日数 38.71%

●2020年5月27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・証券業態を中心に▲0.07～▲0.06%近辺の調達で始まった。調達側から取り急ぐ姿勢は見られず、一巡後は▲0.08%近辺で散発的な出合いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(5/28-5/29)は、▲0.11～▲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>

アウトライト市場は、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.150～▲0.145%で出合う中、平均落札利回▲0.1627%、按分落札利回▲0.1607%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.190～▲0.182%出合いと強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.198%で出合った。

<CP市場>

本日のCP発行市場は月末発行にあたり、建設・鉄鋼・商社等幅広い業態において大型発行が実施され活況なマーケットとなった。償還総額7,500億円程度に対して、発行総額は6,300億円程度と償還超であった。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

2020/5/27	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.059				－	▲ 0.089
T/N			▲ 0.080				－	▲ 0.099
S/N							－	－
1W	▲ 0.080	▲ 0.001	▲ 0.015				－	▲ 0.099
2W			▲ 0.065				－	▲ 0.101
3W							－	▲ 0.103
1M			▲ 0.065				－	▲ 0.109
3M							▲ 0.117	▲ 0.123
6M							▲ 0.194	▲ 0.166
1Y							▲ 0.198	▲ 0.187

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.003	▲ 0.003	21,419.23	148.06	107.49-50	107.52-53

日付	5/20	5/21	5/22	5/25	5/26
日銀当預残	4,181,200	4,166,900	4,223,200	4,180,700	4,206,800
準備預金残	3,578,300	3,588,900	3,639,900	3,603,800	3,628,600
マネタリーベース	5,339,600	5,325,700	5,382,200	5,339,800	5,366,700
無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.062%	▲0.059%	▲0.059%	▲0.060%
コール市場残高	134,638	131,713	134,565	136,954	137,582
うち無担	115,375	111,576	115,475	116,885	119,629
うちO/N	66,256	68,277	70,076	70,456	72,680
うち有担	19,263	20,137	19,090	20,069	17,953

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	910	－	25,000	2020/6/1	2020/11/25	114,866.0	20,273.7	100.0780	**▲0.1607%**	**79.5192%**	100.0790	**▲0.1627%**	4,726.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/5/27	2020/5/28	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/5/27	2020/5/28	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/29	2020/6/5	0.300	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/29	2020/8/20	0.300	1,501	1,501				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2020/5/28	2020/8/21		945	945		▲0.100	▲0.100	

●2020年5月28日の予定

*月例経済報告
*米国1-3月期のGDP改定値
*米国4月の耐久財新規受注
*2年利付国債入札
（20,000億円、6/1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。
◆本資料は何ら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論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