Central Daily Market Report

2020年5月29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	2020年5月29日 需給速報		2020年6月1日 需給予想		2020年6月2日 当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 100		1,000	
財政	14,100		▲ 76,000		▲ 18,000	
資金過不足	13,200		▲ 76,100		▲ 17,000	
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			8,700			
CP等買入	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						
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	19,300		▲ 67,300		▲ 17,000	

当座預金残高	4,271,400	4,204,100	4,187,100
準備預金残高	3,681,900		
積み終了先	3,681,600		
超過準備	3,681,500		
非準備預金先	589,500		

6月1日以降の残り所要積立額	
積数	3,800
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	99.89%	日数	51.61%

●2020年5月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.08～▲0.07%近辺の調達で始まった。月末を跨ぐ取引であることから、調達件数が少なく運用サイドが出し残る展開となった。午後は出合い少なく、今月の取引を終えた。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(6/1-6/2)は、▲0.09～▲0.06%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>

本日はTB3M(911回)が実施された。WI取引において▲0.115～▲0.111%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1078%、按分落札利回▲0.1002%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、▲0.102～▲0.100%と、入札と同水準で出合った。この他に、6M物が▲0.194%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は償還額ゼロに対し、発行総額は170億円程度と閑散なマーケットとなった。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

2020/5/29	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	▲ 0.073				－	▲ 0.106
T/N			▲ 0.080				－	▲ 0.073
S/N							－	－
1W	▲ 0.080	▲ 0.001	▲ 0.060				－	▲ 0.091
2W	▲ 0.070	▲ 0.015	▲ 0.024				－	▲ 0.094
3W							－	▲ 0.099
1M							－	▲ 0.104
3M							▲ 0.100	▲ 0.119
6M							▲ 0.196	▲ 0.163
1Y							▲ 0.200	▲ 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)
0.000	0.005	21,877.89	▲ 38.42	107.64-65	107.20-21

日付	5/22	5/25	5/26	5/27	5/28
日銀当預残	4,223,200	4,180,700	4,206,800	4,242,000	4,252,100
準備預金残	3,639,900	3,603,800	3,628,600	3,648,500	3,660,100
マネタリーベース	5,382,200	5,339,800	5,366,700	5,402,500	5,414,200
無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.059%	▲0.060%	▲0.059%	▲0.057%
コール市場残高	134,565	136,954	137,582	143,574	142,058
うち無担	115,475	116,885	119,629	122,911	124,026
うちO/N	70,076	70,456	72,680	74,652	75,327
うち有担	19,090	20,069	17,953	20,663	18,032

●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	911	－	81,400	2020/6/1	2020/8/31	181,543.0	66,182.6	100.0250	▲0.1002%	14.1201%	100.0269	▲0.1078%	15,217.0

●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
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,500	2020/6/1			7,349	3,502	▲0.002		0.000	27.4
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,700	2020/6/1			9,502	3,705	0.000		0.001	91.1
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,200	2020/6/1			4,817	1,208	0.004		0.005	19.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/5/29	2020/6/1	▲ 0.350	63	63		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/5/29	2020/6/1	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/2	2020/6/9	0.300	0	0				

●2020年6月1日の予定

*1-3月期の法人企業統計調査季報
*米国4月の建設支出
*米国5月のISM製造業景況指数

◆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