

Central Daily Market Report

2019年5月9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	2019年5月9日		2019年5月10日		2019年5月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	5,700		4,800		2,000	
財政	▲ 46,000		700		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 40,300		5,500		▲ 1,000	
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						▲ 4,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			5,500			
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
ETF買入						
国債補完供給						
当預増減	▲ 40,400		10,200		▲ 5,100	
当座預金残高	3,937,400		3,947,600		3,942,500	
準備預金残高	3,488,700					
積み終了先	3,488,500				5月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,488,400				積数 1,000	
非準備預金先	448,700				1日平均 200	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,074,900	
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	80.00%		

●2019年5月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担ONは、邦銀・証券業態から▲0.065~▲0.03%での調達で始まった。積み期後半となることや、税揚げ日にあたったことで、参加者の資金調達意欲は旺盛であった。都銀・信託業態の調達は▲0.065~▲0.04%と、昨日に比べて強含む展開となった。一巡後は▲0.065~▲0.05%で散發的な出合いが見られた程度であった。ターム物に関しては、ショートターム物を中心に数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(5/10-5/13)は、▲0.075~▲0.05%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。10Y334~354、5Y130~139、30Y59~62などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.150%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1518%、按分落札利回▲0.1458%と、水準感からの買いも入ったことから、前日の3M物に引き続き順調な結果となった。結果発表後のセカンドリーマーケットでは、出合いは無かった。また、3M物が▲0.160~▲0.155%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は、300億円弱の償還に対して、1,000億円強の発行が見られた。鉄鋼業態が大型発行を実施したが、案件は少なかった。発行レートに特段の変化は見られていない。

●短期金融市場関連指標

2019/5/9	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.063	▲ 0.050	0.005	21,402.13	▲ 200.46	110.02-03	109.62-63
T/N	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.040				-	▲ 0.068						
2W			0.001				-	▲ 0.085						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.097						
1M	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.020				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.160	▲ 0.126						
6M							▲ 0.152	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.157						
									日付	4/24	4/25	4/26	5/7	5/8
									日銀当預残	3,977,400	3,992,100	3,982,800	3,972,600	3,977,800
									準備預金残	3,463,200	3,467,900	3,457,800	3,461,700	3,474,100
									マネタリーベース	5,129,900	5,151,400	5,147,100	5,131,700	5,130,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.075%	▲ 0.075%	▲ 0.073%	▲ 0.070%	▲ 0.061%
									コール市場残高	100,335	95,727	90,959	104,225	107,032
									うち無担	80,001	79,921	69,535	77,287	83,182
									うちO/N	35,191	33,421	35,615	43,927	50,303
									うち有担	20,334	15,806	21,424	26,938	23,850

●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	830	-	23,000	2019/5/10	2019/11/11	80,253.0	18,728.6	100.0740	▲0.1458%	17.0355%	100.0770	▲0.1518%	4,271.0

●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1年以下)	500	2019/5/10			1,529	503	0.005		0.007	63.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/5/10			12,393	4,809	▲0.004		▲0.003	96.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	36,374	2019/5/9	2019/5/10		1	1		▲0.600	▲0.600	

●2019年5月10日の予定

*決定会合における主な意見(4月24、25日分)	*米国4月の財政収支	*国庫短期証券(831回)入札(3ヶ月、42,800億円、5/13発行)
*3月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比1.7%)	*米国4月の消費者物価指数	*10年物価連動国債(4,000億円、5/13発行)
*3月の毎月勤労統計調査速報	*英国1-3月期のGDP速報値	*エネルギー対策借入(8,500億円、5/20借入)

◆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