

# Central Daily Market Report

2019年5月10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	2019年5月10日 需給速報	2019年5月13日 需給予想	2019年5月14日 当社予想
銀行券	4,800	4,100	4,000
財政	▲ 900	▲ 6,600	▲ 4,000
資金過不足	3,900	▲ 2,500	0
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		3,000	▲ 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		▲ 800	▲ 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			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 200		200
当預増減	8,400	▲ 3,500	0
当座預金残高	3,945,800	3,942,300	3,942,300
準備預金残高	3,478,300		
積み終了先	3,478,100		
超過準備	3,478,000		
非準備預金先	467,500		
積み期間 (4/16~5/15) の所要準備額			3,084,800
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			90.00%

## ●2019年5月10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▲0.055~▲0.02%での調達で始まった。今積み期間最後の週末ということもあり引続き調達意欲は旺盛であった。一巡後は▲0.055~▲0.03%で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。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(5/13-5/14)は、▲0.065~▲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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.170~▲0.160%と強めの出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1602%、按分落札利回▲0.1526%と、WI取引ほどの強さは見られない結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.161~▲0.155%の出合いと堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.152~▲0.148%で、1Y物が▲0.168~▲0.164%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、償還・発行ともに700億円程の規模であった。機械業態からまとまったロットでの発行が見られた程度で、案件数は少なかった。発行レートに変動はなく、0%付近に張り付いている。

## ●短期金融市場関連指標

2019/5/10	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.067	▲ 0.050	0.000	21,344.92	▲ 57.21	109.82-83	109.76-77
T/N							-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.026				-	▲ 0.079						
2W			0.000				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.104						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.161	▲ 0.127						
6M							▲ 0.152	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.157						
									日付	4/25	4/26	5/7	5/8	5/9
									日銀当預残	3,992,100	3,982,800	3,972,600	3,977,800	3,937,400
									準備預金残	3,467,900	3,457,800	3,461,700	3,474,100	3,488,500
									マネタリーベース	5,151,400	5,147,100	5,131,700	5,130,000	5,083,900
									無担O/N加重平均	▲0.075%	▲0.073%	▲0.070%	▲0.061%	▲0.048%
									コール市場残高	95,727	90,959	104,225	107,032	110,460
									うち無担	79,921	69,535	77,287	83,182	85,509
									うちO/N	33,421	35,615	43,927	50,303	51,100
									うち有担	15,806	21,424	26,938	23,850	24,951

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	831	-	42,800	2019/5/13	2019/8/13	116,020.5	34,931.3	100.0385	▲0.1526%	93.6873%	100.0404	▲0.1602%	7,868.0
物価連動10年	24	0.10%	4,000	2019/5/13	2029/3/10	14,868.0	3,999.0	103.7000	▲0.2660%	94.4029%			
エネルギー対策	-	-	8,500	2019/5/20	2020/5/20	137,315.0	8,499.95		0.0000%	6.1902%		0.0000%	

## ●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	15,000	2019/5/13	2019/5/27		3,003	3,003				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	65,878	2019/5/10	2019/5/13		211	211		▲0.500	▲0.500	

## ●2019年5月13日の予定

- \*3月の景気動向指数速報
- \*4月のマネタリーベースと日本銀行の取引

◆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