

Central Daily Market Report

2019年5月13日(月)
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13日 需給速報	2019年5月14日 需給予想	2019年5月15日 当社予想			
銀行券	4,000	3,100	4,000			
財政	▲ 3,100	▲ 900	▲ 1,000			
資金過不足	900	2,200	3,000			
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	3,000	▲ 4,100				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,600			
CP等買入		▲ 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	▲ 1,800	200	1,800			
当預増減	▲ 1,900		11,600			3,000
当座預金残高	3,943,900		3,955,500			3,958,500
準備預金残高	3,485,200					
積み終了先	3,484,900				5月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,484,900				積数	200
非準備預金先	458,700				1日平均	100
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	93.33%		

●2019年5月13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▲0.045~▲0.02%での調達で始まった。先週に引続き都銀・信託業態の調達意欲は旺盛で▲0.035~▲0.02%で出合いが見られた。一巡後は▲0.035~▲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(5/14-5/15)は、▲0.065~▲0.055%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。5Y130~139、10Y334~354、20Y167~168、30Y59~62、40Y11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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.161%、6M物が▲0.154%、1Y物が▲0.170%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、商社、電機機器、建設、ゴム等から大型案件が見られ、2,500億円程度の償還に対して、2,800億円程度の発行と、若干の発行超となった。発行レートは概ね0%近辺であった。

●短期金融市場関連指標

2019/5/13	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	▲ 0.028				-	▲ 0.068	▲ 0.050	0.000	21,191.28	▲ 153.64	109.64-66	109.64-65
T/N							-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.013				-	▲ 0.098						
3W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.105						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.161	▲ 0.130						
6M							▲ 0.154	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.157						
									日付	4/26	5/7	5/8	5/9	5/10
									日銀当預残	3,982,800	3,972,600	3,977,800	3,937,400	3,945,800
									準備預金残	3,457,800	3,461,700	3,474,100	3,488,500	3,478,300
									マネタリーベース	5,147,100	5,131,700	5,130,000	5,083,900	5,087,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.073%	▲ 0.070%	▲ 0.061%	▲ 0.048%	▲ 0.033%
									コール市場残高	90,959	104,225	107,032	110,460	100,623
									うち無担	69,535	77,287	83,182	85,509	78,459
									うちO/N	35,615	43,927	50,303	51,100	47,055
									うち有担	21,424	26,938	23,850	24,951	22,164

●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	業分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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年超3年以下)	3,500	2019/5/14			12,802	3,504	▲0.001		0.000	67.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/5/14			18,315	4,011	0.001		0.001	80.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	180,963	2019/5/13	2019/5/14		1,636	1,636		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,900	2019/5/13	2019/5/14		69	69		▲0.500	▲0.500	

●2019年5月14日の予定

*3月の国際収支	*30年利付国債入札
*4月の景気ウォッチャー調査	(7,000億円、5/15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