

Central Daily Market Report

2019年5月14日(火)
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14日		2019年5月15日		2019年5月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,300		3,000		4,000	
財政	▲ 3,400		4,900		1,000	
資金過不足	▲ 100		7,900		5,000	
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			7,500			
国債買入	7,600					
CP等買入			▲ 500			
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			100			
国債補充供給	▲ 1,100	1,800	1,100			
当増増減	8,200		16,100		5,000	
当座預金残高	3,952,100		3,968,200		3,973,200	
準備預金残高	3,483,300					
積み終了先	3,483,300		5月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,483,100		積数		0	
非準備預金先	468,800		1日平均		0	
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	100.00%	日数	96.67%		

●2019年5月14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▲0.035~▲0.01%での調達で始まった。積み最終日を前に引き続き調達意欲は強く、都銀・信託業態で▲0.035~▲0.02%、地銀業態で▲0.035~▲0.01%での出合いが見られた。一巡後も▲0.035~▲0.025%で取引が行われた。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>

GC T/N(5/15-5/16)は、▲0.085~▲0.065%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、小幅低下。アウトライト市場では、短国買入オペが7,500億円(前回比+2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.015%、按分落札利回較差+0.006%と、引け値の低い銘柄の在庫調整の売りから小甘い結果となった。一方、マーケットでは、3M物が▲0.163~▲0.161%、6M物が▲0.160~▲0.154%、1Y物が▲0.164%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。発行市場は案件少なく、発行は250億円程度と閑散であった(償還350億円程度)。発行レートは引き続き0%近辺であった。

●短期金融市場関連指標

2019/5/14	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.067	▲ 0.055	▲ 0.005	21,067.23	▲ 124.05	109.15-16	109.67-68		
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.070								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.035				-	▲ 0.092								
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.103								
3W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.005				-	▲ 0.111								
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.123								
3M			▲ 0.040				▲ 0.163	▲ 0.132								
6M							▲ 0.160	▲ 0.151								
1Y							▲ 0.169	▲ 0.157								
											日付	5/7	5/8	5/9	5/10	5/13
											日銀当預残	3,972,600	3,977,800	3,937,400	3,945,800	3,943,900
											準備預金残	3,461,700	3,474,100	3,488,500	3,478,300	3,485,200
											マネタリーベース	5,131,700	5,130,000	5,083,900	5,087,600	5,081,600
											無担O/N加重平均	▲ 0.070%	▲ 0.061%	▲ 0.048%	▲ 0.033%	▲ 0.028%
											コール市場残高	104,225	107,032	110,460	100,623	102,535
											うち無担	77,287	83,182	85,509	78,459	79,101
											うちO/N	43,927	50,303	51,100	47,055	46,647
											うち有担	26,938	23,850	24,951	22,164	23,434

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非償格競争入札(億円)
30年利付国債	62	0.50%	7,000	2019/5/15	2049/3/20	26,353.0	5,670.00	99.2000	0.5310%	96.5889%	99.2300	0.5290%	1,324.0

●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
国庫短期証券買入	7,500	2019/5/15			19,726	7,501	0.006		0.015	36.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	47,942	2019/5/14	2019/5/15		1,076	1,076		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	12,267	2019/5/14	2019/5/15		0	0				
米ドル資金供給		2019/5/16	2019/5/23	2.87	0	0				

●2019年5月15日の予定

*3月の特定サービス産業動態統計速報	*米国3月の企業在庫	*交付税特別会計借入
*4月のマネーストック	*米国4月の小売売上高	(10,500億円、5/24借入)
	*米国4月の鉱工業生産・設備稼働率	
	*ユーロ圏1-3月期のGDP2次速報	

◆本資料は信頼できるとさ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読みする書面や目録見書をよくお読みください。