

Central Daily Market Report

2019年5月15日(水)

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15日		2019年5月16日		2019年5月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,100		2,200		2,000	
財政	5,400		1,800		▲ 21,000	
資金過不足	8,500		4,000		▲ 19,000	
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			5,200			
CP等買入		▲ 500		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					300	▲ 300
社債等買入						
E T F 買入	100					
国債補完供給	▲ 1,100	1,100		1,100		
当預増減	15,600		10,200		▲ 19,000	
当座預金残高	3,967,700		3,977,900		3,958,900	
準備預金残高	3,501,200					
積み終了先	3,501,200					
超過準備	3,501,200					
非準備預金先	466,500					
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,202,100	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2019年5月15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。積み最終日となり、ややビッド数が減少したものの引き続き調達意欲は強く、一巡後も同水準で散発的な出合いが見られた。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(5/16-5/17)は、▲0.11~▲0.10%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、新積み期に入り低下した。アウトライト市場は、翌日に1Y物の入札を控えて動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は目立った大型案件も見られず、発行額は500億円程度であった(償還800億円程度)。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

2019/5/15	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.084	▲ 0.055	0.000	21,188.56	121.33	109.67-68	109.50-52
T/N							-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.036				-	▲ 0.111						
2W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.029				-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.038	▲ 0.030	▲ 0.034				-	▲ 0.123						
3M			▲ 0.040				▲ 0.163	▲ 0.133						
6M							▲ 0.160	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.169	▲ 0.158						
									日付	5/8	5/9	5/10	5/13	5/14
									日銀当預残	3,977,800	3,937,400	3,945,800	3,943,900	3,952,100
									準備預金残	3,474,100	3,488,500	3,478,300	3,485,200	3,483,300
									マネタリーベース	5,130,000	5,083,900	5,087,600	5,081,600	5,086,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.061%	▲ 0.048%	▲ 0.033%	▲ 0.028%	▲ 0.023%
									コール市場残高	107,032	110,460	100,623	102,535	101,602
									うち無担	83,182	85,509	78,459	79,101	79,567
									うちO/N	50,303	51,100	47,055	46,647	46,433
									うち有担	23,850	24,951	22,164	23,434	22,035

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/5/24	2019/11/22	260,244.0	10,500.16		0.0000%	4.0348%		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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/5/16			13,119	4,811	0.000		0.001	50.9
国債買入(物価連動債)	250	2019/5/16			1,097	253	0.050		0.014	7.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	25,134	2019/5/15	2019/5/16		1093	1093		▲ 0.500	▲ 0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第97回	2019/5/17	2020/5/15	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第36回	2019/5/17	2020/5/15	0
				300

●2019年5月16日の予定

*4月の企業物価指数	*米国4月の住宅着工件数	*国庫短期証券(832回)入札(1年、19,000億円、5/20発行)
		*5年利付国債入札Y(19,000億円、5/17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お客様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