

Central Daily Market Report

2019年5月16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16日 需給速報	2019年5月17日 需給予想	2019年5月20日 当社予想
銀行券	2,400	2,100	1,000
財政	200	▲ 19,300	▲ 1,000
資金過不足	2,600	▲ 17,200	0
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 1,500
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	5,200		
CP等買入		▲ 100	▲ 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		700	
国債補完供給	▲ 900	1,100	900
当預増減	7,900	▲ 15,700	▲ 1,500
当座預金残高	3,975,600	3,959,900	3,958,400
準備預金残高	3,473,600		
積み終了先	2,126,800		
超過準備	894,200		
非準備預金先	502,000		
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	80.55%	日数
			3.23%

●2019年5月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.080～▲0.030%の出合いが中心となった。新積み期に入ったことから資金調達サイドの慎重姿勢が強まり、レートは低下しての推移となった。一巡後は▲0.080%で調整の出合いが見られた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(5/17-5/20)は、▲0.11～▲0.09%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。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.170～▲0.168%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1603%、按分落札利回▲0.1553%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、▲0.159～▲0.157%出合いと按分レート近辺で推移した。

<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20日発行の応当日にあたり、食品、化学等から大型案件が見られた。発行額は、2,500億円程度と若干の発行超となった(償還2,400億円程度)。発行レートは引き続き0%近辺。本日CP等買入オペアが2,500億円オファーされた。按分落札レート▲0.001%、平均落札レート0.004%と、按分・平均ともに前回(按分▲0.002%平均0.001%)比で上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2019/5/16	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.096	▲ 0.065	▲ 0.010	21,062.98	▲ 125.58	109.46-48	109.45-46
T/N							-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.041				-	▲ 0.112						
2W	▲ 0.048	▲ 0.015	▲ 0.042				-	▲ 0.114						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.118						
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.163	▲ 0.131						
6M							▲ 0.159	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.157						
									日付	5/9	5/10	5/13	5/14	5/15
									日銀当預残	3,937,400	3,945,800	3,943,900	3,952,100	3,967,700
									準備預金残	3,488,500	3,478,300	3,485,200	3,483,300	3,501,300
									マネタリーベース	5,083,900	5,087,600	5,081,600	5,086,600	5,099,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.048%	▲ 0.033%	▲ 0.028%	▲ 0.023%	▲ 0.025%
									コール市場残高	110,460	100,623	102,535	101,602	101,934
									うち無担	85,509	78,459	79,101	79,567	78,917
									うちO/N	51,100	47,055	46,647	46,433	48,658
									うち有担	24,951	22,164	23,434	22,035	23,017

●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	832	-	19,000	2019/5/20	2020/5/20	67,383.0	15,674.6	100.1560	▲0.1553%	10.2463%	100.1610	▲0.1603%	3,325.0
5年利付国債	139	0.10%	19,000	2019/5/17	2024/3/20	76,229.0	15,438.0	101.3100	▲0.1680%	16.6556%	101.3200	▲0.1700%	3,551.0

●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
CP等買入	2,500	2019/5/21			7,187	2,470	▲0.001		0.004	74.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,000	2019/5/16	2019/5/17		908	908		▲0.500	▲0.500	

●2019年5月17日の予定

*3月の第3次産業活動指数	*米国5月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(832回)入札(3ヶ月、43,000億円、5/20発行)
*3月の石油等消費動向統計	*ユーロ圏4月の消費者物価指数改定値	*国有林野借入(614億円、5/27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