

Central Daily Market Report

2019年5月17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17日 | | 2019年5月20日 | | 2019年5月21日 | |
|-----------------------|------------|--------|------------|---------|-----------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 2,200 | | 2,000 | | 0 | |
| 財政 | ▲ 18,500 | | 1,200 | | ▲ 5,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 16,300 | | 3,200 | | ▲ 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 | | | 600 | ▲ 1,500 | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | | | 2,200 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 100 | | ▲ 400 | 2,500 | |
| 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 | | | | |
| 当預増減 | ▲ 14,800 | | 4,100 | | ▲ 2,500 | |
| 当座預金残高 | 3,960,800 | | 3,964,900 | | 3,962,400 | |
| 準備預金残高 | 3,457,400 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,434,100 | | | | 5月20日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,258,400 | | | | 積数 | |
| 非準備預金先 | 503,400 | | | | 1日平均 | |
| | | | | | 900 | |
| 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 | 99.20% | 日数 | 12.90% | | |

●2019年5月17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~▲0.040%の出会いが中心となった。週末を跨ぐ取引に当たるもの大きく取り上がる動きは見られず、一巡後は▲0.080~▲0.075%で調整の出会いが見られるのみだった。ターム物に関しては、ショートターム物で散発的に出会いが見られていた。

<レポ市場>

GC T/N(5/20-5/21)は、▲0.10~▲0.085%程度での出会い。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。5Y130~138、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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.1525~▲0.151%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1527%、按分落札利回▲0.1463%と、前回債からレートが上昇する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.152~▲0.150%出会いと底堅く推移した。この他に、1Y物が▲0.159~▲0.158%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閑散なマーケットであった。発行額は500億円程度(償還250億円程度)。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

| 2019/5/17 | 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 | ▲ 0.086 | 0.001 | ▲ 0.068 | | | | - | ▲ 0.093 | ▲ 0.060 | 0.005 | 21,250.09 | 187.11 | 109.87-88 | 109.72-73 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.099 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.055 | 0.000 | ▲ 0.046 | | | | - | ▲ 0.105 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.050 | ▲ 0.035 | ▲ 0.041 | | | | - | ▲ 0.110 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.112 | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.040 | | | | - | ▲ 0.118 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.152 | ▲ 0.129 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.158 | ▲ 0.151 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.158 | ▲ 0.157 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 5/10 | 5/13 | 5/14 | 5/15 | 5/16 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,945,800 | 3,943,900 | 3,952,100 | 3,967,700 | 3,975,600 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,478,300 | 3,485,200 | 3,483,300 | 3,501,300 | 3,473,600 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 5,087,600 | 5,081,600 | 5,086,600 | 5,099,100 | 5,104,600 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.033% | ▲0.028% | ▲0.023% | ▲0.025% | ▲0.066% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 100,623 | 102,535 | 101,602 | 101,934 | 102,877 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 78,459 | 79,101 | 79,567 | 78,917 | 80,885 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 47,055 | 46,647 | 46,433 | 48,658 | 53,685 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 22,164 | 23,434 | 22,035 | 23,017 | 21,992 |

●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 | 833 | - | 43,000 | 2019/5/20 | 2019/8/19 | 129,836.9 | 35,724.3 | 100.0365 | ▲0.1463% | 41.4641% | 100.0381 | ▲0.1527% | 7,275.0 |
| 国有林野借入 | - | - | 614 | 2019/5/27 | 2024/5/25 | 2,392.0 | 614.00 | | 0.0000% | 100.0000% | | 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 | 2019/5/20 | 2019/6/3 | | 623 | 623 | | | | |
| 国債買入(残存期間10年超25年以下) | 1,600 | 2019/5/20 | | | 5,546 | 1,612 | 0.004 | | 0.005 | 43.2 |
| 国債買入(残存期間25年超) | 400 | 2019/5/20 | | | 2,303 | 401 | 0.009 | | 0.009 | 93.3 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 10,000 | 2019/5/17 | 2019/5/20 | | 15 | 15 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |

●2019年5月20日の予定

| | |
|-------------------------------------|------------------------------|
| *1-3月期のGDP1次速報 (市場予想：前期比年率▲0.2%) | *流動性供給入札 (6,000億円、5/21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