

Central Daily Market Report

2019年5月20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20日		2019年5月21日		2019年5月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,000		1,800			0
財政	3,900		▲ 4,300			▲ 1,000
資金過不足	5,900		▲ 2,500			▲ 1,000
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		▲ 400	2,500	▲ 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			400			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	6,700		400			▲ 1,000
当座預金残高	3,967,500		3,967,900			3,966,900
準備預金残高	3,465,500					
積み終了先	3,461,100				5月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,455,900				積数	16,000
非準備預金先	502,000				1日平均	600
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	99.50%	日数	16.13%		

●2019年5月20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▲0.086~▲0.050%の出合いが中心となった。一巡後は調整から▲0.086~▲0.070%程度の出合いが散見された程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で散発的に出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T/N(5/21-5/22)は、▲0.095~▲0.07%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、10Y338~354、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▲0.150~▲0.149%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。発行市場はその他金融業態から900億円の大型発行があり、償還総額500億円程度に対して発行総額は1,800億円程度となった。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

2019/5/20	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				-	▲ 0.089	▲ 0.050	0.010	21,301.73	51.64	110.17-18	110.11-12
T/N							-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.042	▲ 0.049				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.055	▲ 0.040	▲ 0.049				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.103						
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.150	▲ 0.127						
6M							▲ 0.163	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.157						
									日付	5/13	5/14	5/15	5/16	5/17
									日銀当預残	3,943,900	3,952,100	3,967,700	3,975,600	3,960,800
									準備預金残	3,485,200	3,483,300	3,501,300	3,473,600	3,457,400
									マナタリーベース	5,081,600	5,086,600	5,099,100	5,104,600	5,087,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.023%	▲ 0.025%	▲ 0.066%	▲ 0.068%
									コール市場残高	102,535	101,602	101,934	102,877	105,666
									うち無担	79,101	79,567	78,917	80,885	77,130
									うちO/N	46,647	46,433	48,658	53,685	48,130
									うち有担	23,434	22,035	23,017	21,992	28,536

●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)
流動性供給	285	-	6,000	2019/5/21		20,212.0	5,990.0		0.0090%	90.0458%		0.0080%	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	41,000	2019/5/20	2019/5/21		60	60		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2019年5月21日の予定

*米国4月の中古住宅販売

◆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