

Central Daily Market Report

2019年5月21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21日		2019年5月22日		2019年5月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,900		1,200		▲ 1,000	
財政	▲ 6,000		▲ 3,800		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 4,100		▲ 2,600		▲ 10,000	
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			5,000			
国債買入			12,800			
CP等買入	2,500	▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
E T F 買入	400		300			
国債補完供給	▲ 900	100		900		
当預増減	▲ 2,100		16,000		▲ 10,000	
当座預金残高	3,965,400		3,981,400		3,971,400	
準備預金残高	3,465,000					
積み終了先	3,461,600		5月22日以降の残り所要積立額		積数 12,000	
超過準備	3,461,100		1日平均		500	
非準備預金先	500,400					
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	99.63%	日数	19.35%		

●2019年5月21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%の出合いが中心となった。一巡後は調整から▲0.085~▲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(5/22-5/23)は、▲0.095~▲0.075%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。アウトライト市場では、短国買入オペが5,000億円(前回は▲2,500億円)でオファーされた。落札利回較差+0.008%、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か小甘い結果となった。一方、マーケットでは、3M物が▲0.153~▲0.149%、1Y物が▲0.157%出合いと底堅く推移した。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は小売・その他金融業態からまとまった案件が実施され、償還総額250億円に対して、発行総額2,000億円程度と発行超のマーケットとなった。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

2019/5/21	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.065				-	▲ 0.086	▲ 0.050	0.000	21,272.45	▲ 29.28	110.08-09	110.12-13
T/N							-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.050				-	▲ 0.094						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.034				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.101						
1M			▲ 0.019				-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.153	▲ 0.127						
6M							▲ 0.161	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.156	▲ 0.157						
									日付	5/14	5/15	5/16	5/17	5/20
									日銀当預残	3,952,100	3,967,700	3,975,600	3,960,800	3,967,500
									準備預金残	3,483,300	3,501,300	3,473,600	3,457,400	3,465,500
									マネタリーベース	5,086,600	5,099,100	5,104,600	5,087,600	5,092,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.023%	▲ 0.025%	▲ 0.066%	▲ 0.068%	▲ 0.068%
									コール市場残高	101,602	101,934	102,877	105,666	96,066
									うち無担	79,567	78,917	80,885	77,130	73,956
									うちO/N	46,433	48,658	53,685	48,130	44,806
									うち有担	22,035	23,017	21,992	28,536	22,110

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	5,000	2019/5/22			15,083	5,001	0.006		0.008	97.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/5/22			13,588	3,516	0.003		0.004	25.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/5/22			10,049	4,006	0.002		0.003	35.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/5/22			9,837	4,808	0.002		0.003	57.7
国債買入(物価連動債)	250	2019/5/22			1,134	254	▲ 0.010		▲ 0.042	55.6
社債等買入	1,000	2019/5/27			1,705	1,000	0.000		0.012	76.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	72,942	2019/5/21	2019/5/22		908	908		▲ 0.600	▲ 0.600	
米ドル資金供給		2019/5/23	2019/5/31	2.88		0				

●2019年5月22日の予定

*長崎県金融経済懇談会において原田審議委員講演	*20Y入札(9,000億円、5/23発行)
*3月の機械受注統計	*交付税特別会計借入(10,500億円、5/31借入)
*4月の貿易統計	
*英国4月の消費者物価指数	

◆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