

# Central Daily Market Report

2019年5月22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22日<br>需給速報 |        | 2019年5月23日<br>需給予想 |        | 2019年5月24日<br>当社予想 |     |
|-----------------------|--------------------|--------|--------------------|--------|--------------------|-----|
| 銀行券                   | 1,100              |        | ▲ 200              |        | ▲ 1,000            |     |
| 財政                    | ▲ 5,500            |        | ▲ 9,500            |        | 1,000              |     |
| 資金過不足                 | ▲ 4,400            |        | ▲ 9,700            |        | 0                  |     |
| 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                 |                    | ▲ 200  |                    | ▲ 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                 |                    | ▲ 200  |                    |        |                    |     |
| E T F 買入              | 300                |        |                    |        |                    |     |
| 国債補充供給                | ▲ 200              | 900    |                    | 200    |                    |     |
| 当増増減                  | 14,000             |        | ▲ 9,600            |        | 0                  |     |
| 当座預金残高                | 3,979,400          |        | 3,969,800          |        | 3,969,800          |     |
| 準備預金残高                | 3,478,400          |        |                    |        |                    |     |
| 積み終了先                 | 3,475,500          |        | 5月23日以降の残り所要積立額    |        |                    |     |
| 超過準備                  | 3,475,500          |        | 積数                 |        | 9,100              |     |
| 非準備預金先                | 501,000            |        | 1日平均               |        | 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                 | 99.72% | 日数                 | 22.58% |                    |     |

## ●2019年5月22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▲0.070~▲0.050%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(5/23-5/24)は、▲0.095~▲0.08%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。発行市場は鉄鋼業態から大型発行があり、償還総額1,200億円程度に対して、発行総額1,500億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

| 2019/5/22 | 無担(速報)  |         |         | 有担(速報) |    |    | 短国      | 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       | ▲ 0.080 | 0.001   | ▲ 0.058 |        |    |    | -       | ▲ 0.084 | ▲ 0.055   | ▲ 0.005   | 21,283.37 | 10.92     | 110.56-57 | 110.36-37 |
| T/N       |         |         |         |        |    |    | -       | ▲ 0.086 |           |           |           |           |           |           |
| S/N       |         |         |         |        |    |    | -       | -       |           |           |           |           |           |           |
| 1W        |         |         | 0.001   |        |    |    | -       | ▲ 0.092 |           |           |           |           |           |           |
| 2W        | ▲ 0.050 | ▲ 0.020 | ▲ 0.030 |        |    |    | -       | ▲ 0.095 |           |           |           |           |           |           |
| 3W        | ▲ 0.041 | 0.000   | ▲ 0.028 |        |    |    | -       | ▲ 0.098 |           |           |           |           |           |           |
| 1M        |         |         |         |        |    |    | -       | ▲ 0.105 |           |           |           |           |           |           |
| 3M        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.153 | ▲ 0.124 |           |           |           |           |           |           |
| 6M        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.155 | ▲ 0.151 |           |           |           |           |           |           |
| 1Y        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.150 | ▲ 0.156 |           |           |           |           |           |           |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | 日付        | 5/15      | 5/16      | 5/17      | 5/20      | 5/21      |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | 日銀当預残     | 3,967,700 | 3,975,600 | 3,960,800 | 3,967,500 | 3,965,400 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | 準備預金残     | 3,501,300 | 3,473,600 | 3,457,400 | 3,465,500 | 3,465,000 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | マネタリーベース  | 5,099,100 | 5,104,600 | 5,087,600 | 5,092,300 | 5,088,200 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | 無担O/N加重平均 | ▲0.025%   | ▲0.066%   | ▲0.068%   | ▲0.068%   | ▲0.065%   |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | コール市場残高   | 101,934   | 102,877   | 105,666   | 96,066    | 101,485   |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | うち無担      | 78,917    | 80,885    | 77,130    | 73,956    | 78,918    |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | うちO/N     | 48,658    | 53,685    | 48,130    | 44,806    | 48,318    |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | うち有担      | 23,017    | 21,992    | 28,536    | 22,110    | 22,567    |

## ●入札結果

| 名称      | 回数  | 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 | 棄分率      | 募入平均価格   | 募入平均利回・利回較差 | 第I非価格競争入札(億円) |
|---------|-----|-------|--------|-----------|------------|-----------|-----------|----------|-------------|----------|----------|-------------|---------------|
| 20年利付国債 | 168 | 0.40% | 9,000  | 2019/5/23 | 2039/3/20  | 40,181.0  | 7,351.00  | 100.7000 | 0.3620%     | 23.4032% | 100.7500 | 0.3590%     | 1,641.0       |
| 交付税特会   | -   | -     | 10,500 | 2019/5/31 | 2019/11/29 | 262,202.0 | 10,500.26 |          | 0.0000%     | 4.0047%  |          | 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) | 投分レート・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 | 投分比率 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 28,476         | 2019/5/22 | 2019/5/23 |      | 172           | 172           |                 | ▲0.600          | ▲0.600            |      |

## ●2019年5月23日の予定

\*米国4月の新築一戸建て販売件数

◆本資料は信頼できるとさ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。

◆本資料は何ら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読みする書面や目論見書をよくお読みください。