

# Central Daily Market Report

2019年5月24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24日		2019年5月27日		2019年5月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		700		0	
財政	7,100		▲ 4,600		11,000	
資金過不足	7,400		▲ 3,900		11,000	
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			2,700	▲ 3,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 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	1,000			
E T F 買入	700		400			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	7,600		▲ 2,900		11,000	
当座預金残高	3,980,000		3,977,100		3,988,100	
準備預金残高	3,490,900					
積み終了先	3,490,300		5月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,490,200		積数		5,800	
非準備預金先	489,100		1日平均		300	
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	99.82%	日数	35.48%		

## ●2019年5月24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▲0.060~▲0.030%の出合いが中心となった。週末を跨ぐ取引ということもあり、引き続きビッドサイドの調達ニーズは堅調だった。一巡後は調整から▲0.060~▲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(5/27-5/28)は、▲0.085~▲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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.155~▲0.153%で出合ったものの、発行・償還日ともに海外市場の休日に当たることもあってか、平均落札利回▲0.1499%、按分落札利回▲0.1423%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、▲0.150~▲0.147%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。発行市場は不動産業態1社から1,000億円程度の大型発行が実施され、償還総額1,000億円に対して、発行総額1,800億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

2019/5/24	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.082	▲ 0.075	▲ 0.010	21,117.22	▲ 33.92	109.55-56	109.53-54
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.042	0.000	▲ 0.034				-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.089						
3W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.150	▲ 0.124						
6M							▲ 0.160	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.157						
									日付	5/17	5/20	5/21	5/22	5/23
									日銀当預残	3,960,800	3,967,500	3,965,400	3,979,400	3,972,400
									準備預金残	3,457,400	3,465,500	3,465,000	3,478,400	3,483,300
									マネタリーベース	5,087,600	5,092,300	5,088,200	5,101,100	5,094,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.068%	▲ 0.068%	▲ 0.065%	▲ 0.058%	▲ 0.049%
									コール市場残高	105,666	96,066	101,485	102,775	106,557
									うち無担	77,130	73,956	78,918	80,943	84,527
									うちO/N	48,130	44,806	48,318	50,543	53,902
									うち有担	28,536	22,110	22,567	21,832	22,030

## ●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	834	-	42,800	2019/5/27	2019/8/26	119,751.0	35,071.8	100.0355	▲0.1423%	22.7976%	100.0374	▲0.1499%	7,727.0
流動性供給	286	-	4,000	2019/5/27		19,393.0	3,984.0		▲0.0050%	70.5330%		▲0.0060%	
交付税特会	-	-	10,500	2019/6/4	2019/12/4	242,913.0	10,500.01		0.0000%	4.3226%		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	2019/5/27	2019/6/10		2,744	2,744				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,892	2019/5/24	2019/5/27		105	105		▲0.500	▲0.500	

## ●2019年5月27日の予定

*黒田日銀総裁、T20サミットにおいて講演	*New York祝日(Memorial Day)
	*London祝日(Spring Bank Holiday)

◆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