

# Central Daily Market Report

2019年5月27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27日		2019年5月28日		2019年5月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		500		0	
財政	▲ 5,400		13,600		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 4,700		14,100		▲ 4,000	
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			10,200			
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	1,000					
E T F 買入	400		400			
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 3,700		24,500		▲ 4,000	
当座預金残高	3,976,300		4,000,800		3,996,800	
準備預金残高	3,478,500					
積み終了先	3,478,000				5月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,478,000				積数 5,200	
非準備預金先	497,800				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	99.84%	日数	38.71%		

## ●2019年5月27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▲0.070~▲0.030%の出会いとなった。立ち上がりは▲0.055~▲0.030%を中心に、一巡後は▲0.040~▲0.030%で散発的な出会いが見られるなど堅調な展開であった。ターム物に関しては、散発的な出会いが見られた程度であった。

### <レポ市場>

GC T/N(5/28-5/29)は▲0.10~▲0.07%程度の出合いだった。前場はオフアが優勢で前日並みの水準の取引だったが、引け頃にかけてややレートを下げた。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。個別銘柄では10Y336~354、5Y129~136、30Y54、59等にビッドの出入りがあった。

### <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▲0.152%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、医薬品業態で大型案件がみられ、償還総額300億円程度に対して、発行総額は1,100億円程度と発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/5/27	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	▲ 0.041				-	▲ 0.081	▲ 0.070	0.005	21,182.58	65.36	109.39-40	109.57-58
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.094						
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.152	▲ 0.125						
6M							▲ 0.165	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.157						
									日付	5/20	5/21	5/22	5/23	5/24
									日銀当預残	3,967,500	3,965,400	3,979,400	3,972,400	3,980,000
									準備預金残	3,465,500	3,465,000	3,478,400	3,483,300	3,490,900
									マネタリーベース	5,092,300	5,088,200	5,101,100	5,094,300	5,101,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.068%	▲ 0.065%	▲ 0.058%	▲ 0.049%	▲ 0.042%
									コール市場残高	96,066	101,485	102,775	106,557	108,655
									うち無担	73,956	78,918	80,943	84,527	86,543
									うちO/N	44,806	48,318	50,543	53,902	51,068
									うち有担	22,110	22,567	21,832	22,030	22,112

## ●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	オフア額(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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/5/28			2,318	502	0.019		0.027	29.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/5/28			11,269	3,510	0.002		0.003	65.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/5/28			11,039	4,003	0.000		0.002	6.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,600	2019/5/28			4,977	1,609	0.003		0.004	54.0
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/5/28			1,788	402	0.003		0.005	18.0

## ●2019年5月28日の予定

*4月の企業向けサービス価格指数	*米国3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(4,000億円、5/29発行)
	*米国5月のCB消費者信頼感指数	

◆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お客様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