# Central Daily Market Report

2019年5月28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28日 需給速報 | | 2019年5月29日 需給予想 | | 2019年5月30日 当社予想 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 銀行券 | 600 | | 600 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | 15,000 | | ▲ 5,800 | | ▲ 2,000 | |
| 資金過不足 | 15,600 | | ▲ 5,200 | | ▲ 3,000 | |
| 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 | | | 2,500 | | | |
| 国債買入 | 10,200 | | | | | |
| 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 | | | | | | |
| ＥＴＦ買入 | 400 | | 700 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 100 | | | 100 | | |
| 当預増減 | 25,900 | | ▲ 2,000 | | ▲ 3,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 4,002,200 | 4,000,200 | 3,997,200 |
| 準備預金残高 | 3,501,100 | | |
| 積み終了先 | 3,500,600 | 5月29日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,500,600 | 積数 | 4,700 |
| 非準備預金先 | 501,100 | 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 99.85% | 日数 | 41.94% |

## ●2019年5月28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▲0.075～▲0.030%の出合いとなった。一巡後は▲0.070～▲0.030%で調整の出合いが見られていた。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(5/29-5/30)は▲0.10～▲0.08%程度の出合いだった。前日同様、引け頃にかけてややレートを下げる展開だった。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等にビッドの出入りがあった一方、入札のあった40年債の新発には目立った動きが見られなかった。

**<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2,500億円（前回比▲2,500億円）でオファーされた。応札額こそ9,282億円と多かったものの、平均落札利回較差+0.005%、按分落札利回較差+0.002%と堅調なマーケットを反映して落ち着いた結果となった。マーケットでは、引け際に3M物が▲0.154～▲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、償還総額300億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と発行超となった。発行レートは、一部銘柄を除いて、概ね横ばい圏で推移した。本日はCP等買入オペが、2,000億円オファーされた。平均落札レート0.001%、按分落札レート▲0.001%と、前回比（平均0.004%、按分▲0.001%）で平均レートは低下、按分レートは横ばいであった。

## ●短期金融市場関連指標

| 2019/5/28 | 無担（速報） | | | 有担（速報） | | | 短国 | 東京レポレート |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 単位：% | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | 平均 | 売買参考統計値 | 平均値 |
| O/N | ▲ 0.080 | 0.001 | ▲ 0.042 | | | | － | ▲ 0.090 |
| T/N | | | | | | | － | ▲ 0.091 |
| S/N | | | | | | | － | － |
| 1W | ▲ 0.035 | 0.001 | ▲ 0.032 | | | | － | ▲ 0.094 |
| 2W | | | | | | | － | ▲ 0.095 |
| 3W | | | | | | | － | ▲ 0.100 |
| 1M | | | | | | | － | ▲ 0.108 |
| 3M | | | ▲ 0.040 | | | | ▲ 0.154 | ▲ 0.125 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.165 | ▲ 0.151 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.162 | ▲ 0.157 |

| JGB新発10年債 | | 日経平均株価 | | ドル/円 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 | 為替（9時） | 為替（17時） |
| ▲ 0.075 | ▲ 0.005 | 21,260.14 | 77.56 | 109.51-52 | 109.41-42 |

| 日付 | 5/21 | 5/22 | 5/23 | 5/24 | 5/27 |
|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 3,965,400 | 3,979,400 | 3,972,400 | 3,980,000 | 3,976,300 |
| 準備預金残 | 3,465,000 | 3,478,400 | 3,483,300 | 3,490,900 | 3,478,500 |
| マネタリーベース | 5,088,200 | 5,101,100 | 5,094,300 | 5,101,600 | 5,097,200 |
| 無担O/N加重平均 | ▲0.065% | ▲0.058% | ▲0.049% | ▲0.042% | ▲0.041% |
| コール市場残高 | 101,485 | 102,775 | 106,557 | 108,655 | 105,172 |
| うち無担 | 78,918 | 80,943 | 84,527 | 86,543 | 86,021 |
| うちO/N | 48,318 | 50,543 | 53,902 | 51,068 | 53,656 |
| うち有担 | 22,567 | 21,832 | 22,030 | 22,112 | 19,151 |

## ●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Ｉ非価格競争入札(億円) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 40年利付国債 | 12 | 0.50% | 4,000 | 2019/5/29 | 2059/3/20 | 15,476.0 | 3,995.00 | | 0.5350% | 84.4117% | | | |

## ●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 | 2,500 | 2019/5/29 | | | 9,282 | 2,502 | 0.002 | | 0.005 | 38.8 |
| CP等買入 | 2,000 | 2019/5/31 | | | 6,677 | 1,985 | ▲0.001 | | 0.001 | 38.2 |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分） | 7,586 | 2019/5/28 | 2019/5/29 | | 128 | 128 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |

## ●2019年5月29日の予定

*黒田日銀総裁、日本銀行金融研究所主催2019年国際コンファランスにおいて講演

◆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渡しする書面や目論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