

Central Daily Market Report

2019年5月29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29日 需給速報	2019年5月30日 需給予想	2019年5月31日 当社予想			
銀行券	700	▲ 100	▲ 900			
財政	▲ 6,800	400	▲ 600			
資金過不足	▲ 6,100	300	▲ 1,500			
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						
CP等買入		▲ 100	▲ 100	2,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
E T F 買入	700					
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 2,900	200	500			
当座預金残高	3,999,300	3,999,500	4,000,000			
準備預金残高	3,494,200					
積み終了先	3,493,700			5月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,493,700			積数	4,200	
非準備預金先	505,100			1日平均	200	
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	99.87%	日数	45.16%		

●2019年5月29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%の出会いとなった。一巡後は▲0.070~▲0.060%で調整の出会いが見られていた。ターム物に関してはショートターム物で散発的に出会いが見られていた。

<レポ市場>

GC T/N(5/30-5/31)は▲0.105~▲0.085%程度の出合いだった。前場から運用サイドがしっかりしており、レートは小幅に低下した。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、5Y124、5Y127、5Y129~136、30Y59、40Y6~11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、低下した。アウトライト市場は、債券相場全体が堅調に推移する中、3M物が▲0.160~▲0.158%、1Y物が▲0.167~▲0.162%出合いと強含みで推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は複数業態で大型発行が観測されたが、月末発行日としては銘柄数、発行額ともにやや控えめだったため、償還総額8,800億円程度に対して、発行総額は8,200億円程度と償還超となった。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。

●短期金融市場関連指標

2019/5/29	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.099	▲ 0.097	▲ 0.022	21,003.37	▲ 256.77	109.35-37	109.20-21
T/N							-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.036				-	▲ 0.102						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.108						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.160	▲ 0.129						
6M							▲ 0.165	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.157						
									日付	5/22	5/23	5/24	5/27	5/28
									日銀当預残	3,979,400	3,972,400	3,980,000	3,976,300	4,002,200
									準備預金残	3,478,400	3,483,300	3,490,900	3,478,500	3,501,200
									マネタリーベース	5,101,100	5,094,300	5,101,600	5,097,200	5,122,500
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.049%	▲0.042%	▲0.041%	▲0.042%
									コール市場残高	102,775	106,557	108,655	105,172	104,255
									うち無担	80,943	84,527	86,543	86,021	84,089
									うちO/N	50,543	53,902	51,068	53,656	51,604
									うち有担	21,832	22,030	22,112	19,151	20,166

●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	オフター額(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
米ドル資金供給		2019/5/31	2019/6/6	2.9	0	0				

●2019年5月30日の予定

*櫻井日銀審議委員、 静岡県金融経済懇談会において講演	*米国1-3月期のGDP改定値	*2年利付国債入札 (20,000億円、6/3発行)
--------------------------------	-----------------	-------------------------------

◆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