

Central Daily Market Report

2019年5月31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31日		2019年6月3日		2019年6月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		1,400		1,000	
財政	▲ 200		▲ 38,000		▲ 50,000	
資金過不足	200		▲ 36,600		▲ 49,000	
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			700	▲ 600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,500			
CP等買入	2,000	▲ 1,100		▲ 100		
貸出支援基金(成)					4,300	▲ 6,700
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入			300			
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	800		▲ 28,600		▲ 51,400	
当座預金残高	3,999,000		3,970,400		3,919,000	
準備預金残高	3,490,500					
積み終了先	3,490,300				6月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,490,100				積数 2,300	
非準備預金先	508,500				1日平均 200	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,195,000	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	58.06%		

●2019年5月31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~▲0.040%の出会いとなった。調達サイドの様子見姿勢に加え、月末を跨ぐ取引であることから、出会い水準は低下した。一巡後は▲0.070~▲0.050%で調整の出会いが見られるのみだった。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(6/3-6/4)は▲0.09~▲0.07%程度の出合いだった。積み期間の後半に入って調達サイドが厚く、レートは前日より小幅に上昇した。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、5Y129~136、30Y59、62、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、発行日要因から上昇した。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▲0.162~▲0.160%で出合う展開となったものの、償還日が海外市場の休日に当たることもあってか、平均落札利回▲0.1587%、按分落札利回▲0.1503%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、落札利回りの水準で小動きとなった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は海運業態で大型案件が観測され、償還総額100億円以下に対して、発行総額は700億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

2019/5/31	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.058				-	▲ 0.082	▲ 0.100	▲ 0.014	20,601.19	▲ 341.34	109.33-34	108.77-78
T/N			▲ 0.035				-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.042				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.058	▲ 0.045	▲ 0.048				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.158	▲ 0.128						
6M							▲ 0.165	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.157						
									日付	5/24	5/27	5/28	5/29	5/30
									日銀当預残	3,980,000	3,976,300	4,002,200	3,999,300	3,998,200
									準備預金残	3,490,900	3,478,500	3,501,200	3,494,200	3,493,000
									マネタリーベース	5,101,600	5,097,200	5,122,500	5,118,900	5,117,900
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.041%	▲0.042%	▲0.044%	▲0.051%
									コール市場残高	108,655	105,172	104,255	103,368	105,273
									うち無担	86,543	86,021	84,089	83,746	86,302
									うちO/N	51,068	53,656	51,604	51,061	54,687
									うち有担	22,112	19,151	20,166	19,622	18,971

●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	835	-	42,800	2019/6/3	2019/9/2	112,985.0	35,062.4	100.0375	▲0.1503%	61.1367%	100.0396	▲0.1587%	7,737.0

●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	2019/6/3	2019/6/14		673	673				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/6/3			7,667	4,803	▲0.014		▲0.011	54.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,600	2019/6/3			4,180	1,606	▲0.011		▲0.010	70.5
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/6/3			1,487	405	▲0.012		▲0.012	73.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2019/5/31	2019/6/3		202	202		▲0.600	▲0.600	

●2019年6月3日の予定

*1-3月期の法人企業統計調査季報	*米国4月の建設支出
	*米国5月のISM製造業景況指数

◆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