

Central Daily Market Report

2019年5月7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7日		2019年5月8日		2019年5月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	5,200		6,800		4,000	
財政	▲ 20,200		▲ 11,700		▲ 43,000	
資金過不足	▲ 15,000		▲ 4,900		▲ 39,000	
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						
国債買入	5,000		10,000			
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 10,200		5,100		▲ 39,000	
当座預金残高	3,972,600		3,977,700		3,938,700	
準備預金残高	3,461,700					
積み終了先	3,461,300				5月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,461,300				積数 1,600	
非準備預金先	510,900				1日平均 200	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,074,900	
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	73.33%		

●2019年5月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担ONは、邦銀・証券業態から▲0.08~▲0.03%での調達で始まった。引き続き地銀業態からの調達が中心となったものの、大型連休要因が剥落した事で、都銀・信託業態から▲0.08~▲0.075%で積極的な調達も見られた。一巡後は、▲0.08~▲0.05%で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物を中心に数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(5/8-5/9)は、▲0.095~▲0.080%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。10Y334~354、5Y130~139、30Y59~62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、小幅上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.180~▲0.165%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。超大型連休明け初日となる本日のCP発行市場は、1,800億円弱の償還に対し、発行は200億円程度の発行にとどまり閑散であった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/5/7	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.070				-	▲ 0.099	▲ 0.055	▲ 0.005	21,923.72	▲ 335.01	110.80-81	110.65-66
T/N							-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	0.000	▲ 0.039				-	▲ 0.098						
2W			0.000				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.178	▲ 0.131						
6M							▲ 0.181	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.157						
									日付	4/22	4/23	4/24	4/25	4/26
									日銀当預残	3,985,500	3,990,200	3,977,400	3,992,100	3,982,800
									準備預金残	3,463,800	3,470,100	3,463,200	3,467,900	3,457,800
									マネタリーベース	5,127,000	5,137,100	5,129,900	5,151,400	5,147,100
									無担O/N加重平均	▲0.076%	▲0.077%	▲0.075%	▲0.075%	▲0.073%
									コール市場残高	100,635	92,974	100,335	95,727	90,959
									うち無担	75,763	71,920	80,001	79,921	69,535
									うちO/N	41,323	36,980	35,191	33,421	35,615
									うち有担	24,872	21,054	20,334	15,806	21,424

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/5/8			9,602	3,511	▲0.008		▲0.006	33.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/5/8			10,580	4,008	▲0.009		▲0.008	41.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,600	2019/5/8			6,041	1,608	▲0.013		▲0.012	40.4
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/5/8			1,865	406	▲0.023		▲0.021	3.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30000	2019/5/7	2019/5/8		33	33		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10000	2019/5/7	2019/5/8		29	29		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/5/9	2019/5/16	2.89	0	0				

●2019年5月8日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(3月14・15日分)	*国庫短期証券(829回)入札(3ヶ月、43,400億円、5/9発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、5/16借入)
*4月実績/5月見込み財政資金対民間収支	*10年利付国債入札(21,000億円、5/9発行)	
*4月のマネタリーベース		

◆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