

# Central Daily Market Report

2019年5月30日(木)

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30日		2019年5月31日		2019年6月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		400		1,000	
財政	▲ 900		▲ 600		▲ 30,000	
資金過不足	▲ 1,000		▲ 200		▲ 29,000	
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						▲ 600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100	2,000	▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ETF買入						
国債補完供給						
当預増減	▲ 1,100		600		▲ 29,600	
当座預金残高	3,998,200		3,998,800		3,969,200	
準備預金残高	3,493,000					
積み終了先	3,492,500					
超過準備	3,492,500				5月31日以降の残り所要積立額 積数 3,700	
非準備預金先	505,200				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	99.88%	日数	48.39%		

## ●2019年5月30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~▲0.035%の出会いとなった。調達サイドの様子見姿勢から昨日までのテイクン地合いからは一転し、出会い水準の低下が見られた。一巡後は▲0.065~▲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(5/31-6/3)は▲0.12~▲0.08%程度の出合いだった。前場は月末の警戒感から玉手当ての動きが目立ったが、後場にかけて調達サイドが厚くなり、レートを戻した。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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、長期債が小甘く推移する中、短国は特段の材料もなく閑散な展開となり、3M物が▲0.170%で出合ったのみだった。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場はノンバンク業態で大型案件が観測され、償還総額1,600億円程度に対して、発行総額は2,800億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。

## ●短期金融市場関連指標

2019/5/30	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.091	▲ 0.086	0.011	20,942.53	▲ 60.84	109.56-57	109.74-75
T/N							-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.040				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.027				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.112						
1M							-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.165	▲ 0.129						
6M							▲ 0.165	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.157						
									日付	5/23	5/24	5/27	5/28	5/29
									日銀当預残	3,972,400	3,980,000	3,976,300	4,002,200	3,999,300
									準備預金残	3,483,300	3,490,900	3,478,500	3,501,200	3,494,200
									マネタリーベース	5,094,300	5,101,600	5,097,200	5,122,500	5,118,900
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.042%	▲0.041%	▲0.042%	▲0.044%
									コール市場残高	106,557	108,655	105,172	104,255	103,368
									うち無担	84,527	86,543	86,021	84,089	83,746
									うちO/N	53,902	51,068	53,656	51,604	51,061
									うち有担	22,030	22,112	19,151	20,166	19,622

## ●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)
2年利付国債	401	0.10%	20,000	2019/6/3	2021/6/1	89,741.0	16,496.00	100.5350	▲0.1660%	38.4410%	100.5400	▲0.1690%	3,496.0

## ●オペ結果

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数	
成長基盤強化	本則第36回	2019/6/4	2023/6/2	0	4,293	35
成長基盤強化	ABL等特別第32期	2019/6/5	2023/6/5	0	5	2
成長基盤強化	小口特別第29期	2019/6/4	2023/6/2	0	19.45	9
成長基盤強化	米ドル特別第28期	2019/6/4	2020/6/4		712	19
成長基盤強化	米ドル特別第24期(借り換え)	2019/6/4	2020/6/4		1,396	18
成長基盤強化	米ドル特別第20期(借り換え)	2019/6/4	2020/6/4		3,657	30
成長基盤強化	米ドル特別第16期(借り換え)	2019/6/4	2020/6/4		72	11

## ●2019年5月31日の予定

*4月の完全失業率(市場予想：2.4%)	*米国4月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(835回)入札
*4月の有効求人倍率(市場予想：1.63倍)	*米国5月のシカゴPM景況感指数	(3ヶ月、42,800億円、6/3発行)
*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+0.2%)		
*5月の都区部消費者物価指数(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+1.2%)		
*4月の商業動態統計速報	*4月の住宅着工統計	

◆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