Central Daily Market Report

2019年6月3日（月）
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6月3日 需給速報		2019年6月4日 需給予想		2019年6月5日 当社予想	
銀行券	1,400		700		1,000	
財政	▲ 36,800		▲ 42,500		▲ 21,000	
資金過不足	▲ 35,400		▲ 41,800		▲ 20,000	
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		8,100			
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金（成）			4,300	▲ 6,300		▲ 100
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ＥＴＦ買入	300					
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 27,400		▲ 36,000		▲ 20,100	

当座預金残高	3,971,600	3,935,600	3,915,500
準備預金残高	3,485,800		
積み終了先	3,485,600		
超過準備	3,485,600		
非準備預金先	485,800		

6月4日以降の残り所要積立額	
積数	2,100
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 61.29%

●2019年6月3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▲0.080～▲0.040%の出合いとなった。一巡後は▲0.085～▲0.070%で調整の出合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合いが見られていた。

<レポ市場>
GCT/N(6/4-6/5)は、▲0.09～▲0.08%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。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、小幅低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に1Y物が▲0.175%で出合った。

<CP市場>
現先レートは低位で推移した。発行市場は、案件数は膨らまなかったものの、鉄鋼、石油・石炭業態で比較的まとまった額の調達が実施され、発行総額は1,000億円弱と償還総額の850億円程度を上回った。発行レートは0%近辺の狭いレンジで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/6/3	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.060				－	▲ 0.088
T/N							－	▲ 0.085
S/N							－	－
1W			▲ 0.045				－	▲ 0.088
2W							－	▲ 0.092
3W			0.000				－	▲ 0.106
1M			▲ 0.025				－	▲ 0.120
3M							▲ 0.158	▲ 0.130
6M							▲ 0.170	▲ 0.151
1Y							▲ 0.175	▲ 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）
▲ 0.095	0.005	20,410.88	▲ 190.31	108.21-23	108.24-26

日付	5/27	5/28	5/29	5/30	5/31
日銀当預残	3,976,300	4,002,200	3,999,300	3,998,200	3,999,000
準備預金残	3,478,500	3,501,200	3,494,200	3,493,000	3,490,500
マネタリーベース	5,097,200	5,122,500	5,118,900	5,117,900	5,118,200
無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.042%	▲0.044%	▲0.051%	▲0.059%
コール市場残高	105,172	104,255	103,368	105,273	102,486
うち無担	86,021	84,089	83,746	86,302	80,506
うちO/N	53,656	51,604	51,061	54,687	49,601
うち有担	19,151	20,166	19,622	18,971	21,980

●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Ｉ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年以下）	500	2019/6/4			2,064	500		0.055	0.055	
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,500	2019/6/4			8,138	3,502	▲0.002		▲0.001	94.9
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,000	2019/6/4			14,782	4,009	▲0.005		▲0.004	36.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	22,543	2019/6/3	2019/6/4		2	2		▲0.600	▲0.600	

●2019年6月4日の予定

*5月実績/6月見込み財政資金対民間収支
*5月のマネタリーベース
*米国4月の製造業新規受注・出荷・在庫
*ユーロ圏5月の消費者物価指数速報値
*10年利付国債入札（21,000億円、6/5発行）

◆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