

Central Daily Market Report

2019年6月4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6月4日		2019年6月5日		2019年6月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		800		0	
財政	▲ 44,800		▲ 18,500		5,000	
資金過不足	▲ 43,900		▲ 17,700		5,000	
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			2,500			
国債買入	8,100					
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)	4,300		▲ 6,300			
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入			100			
国債補完供給						
当預増減	▲ 38,100		▲ 15,200		5,000	
当座預金残高	3,933,500		3,918,300		3,923,300	
準備預金残高	3,438,900					
積み終了先	3,438,700				6月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,438,700				積数 1,900	
非準備預金先	494,600				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	99.94%	日数	64.52%		

●2019年6月4日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、税揚げ、交付金の払い日にあたり、邦銀を中心に▲0.080~▲0.045%の出合いとなった。立ち上がりは▲0.065~▲0.045%のレンジで出合った後、一巡後は▲0.080~▲0.070%で調整の出合いが見られた。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(6/5-6/6)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10Y336~353、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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペアが2,500億円(前回と同額)でオファーされた。平均落札利回較差+0.011%、按分落札利回較差+0.007%と、引け値の低い銘柄の在庫調整の売りからか小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.155%、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。月初ということもあり、発行市場は案件膨らまず、発行総額900億円、償還総額400億円程度に留まった。発行レートは概ね横ばい圏で推移している。本日はCP等買入オペアが2,500億円オファーされた。結果は平均落札レート0.001%、按分落札レート▲0.001%と、平均、按分ともに前回比横ばいとなった。按分比率は96.0%と、前回の38.2%から大きく上昇した。

●短期金融市場関連指標

2019/6/4	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.086	▲ 0.105	▲ 0.010	20,408.54	▲ 2.34	108.03-04	108.04-06
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.021				-	▲ 0.093						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.106						
1M							-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.156	▲ 0.128						
6M							▲ 0.170	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.157						
									日付	5/28	5/29	5/30	5/31	6/3
									日銀当預残	4,002,200	3,999,300	3,998,200	3,999,000	3,971,600
									準備預金残	3,501,200	3,494,200	3,493,000	3,490,500	3,485,800
									マネタリーベース	5,122,500	5,118,900	5,117,900	5,118,200	5,089,500
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.044%	▲0.051%	▲0.059%	▲0.060%
									コール市場残高	104,255	103,368	105,273	102,486	94,516
									うち無担	84,089	83,746	86,302	80,506	75,534
									うちO/N	51,604	51,061	54,687	49,601	46,279
									うち有担	20,166	19,622	18,971	21,980	18,982

●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)
10年利付国債	354	0.10%	21,000	2019/6/5	2029/3/20	68,380.0	17,153.00	102.0100	▲0.1030%	15.1237%	102.0400	▲0.1060%	3,837.0

●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
国庫短期証券買入	2,500	2019/6/5			7,374	2,500	0.007		0.011	29.0
CP等買入	2,500	2019/6/7			4,911	2,477	▲0.001		0.001	96.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	18,923	2019/6/4	2019/6/5		2	2		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/6/6	2019/6/13	2.9	0	0				

●2019年6月5日の予定

*6月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国ページブック *米国5月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入 (10,500億円、6/14借入)
-------------------	--------------------------------	---------------------------------

◆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