

Central Daily Market Report

2019年6月5日(水)

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5日		2019年6月6日		2019年6月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900	▲ 200				0
財政	▲ 19,800	2,700				▲ 4,000
資金過不足	▲ 18,900	2,500				▲ 4,000
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						
CP等買入		▲ 100		▲ 200		2,500
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	100		100			
国債補完供給						
当預増減	▲ 16,400	2,400				▲ 1,500
当座預金残高	3,917,100	3,919,500				3,918,000
準備預金残高	3,427,300					
積み終了先	3,427,100					
超過準備	3,427,100					
非準備預金先	489,800					
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	99.95%	日数	67.74%		

●2019年6月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.075~▲0.045%の出合いとなった。立ち上がりは▲0.060~▲0.045%のレンジで出合い、一巡後は▲0.075%で調整が見られた程度であった。ターム物に関しては特段の出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(6/6-6/7)は、▲0.095~▲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、横ばい圏内で推移した。アウトライト市場は、債券市場全体が強含みで推移する中、1Y物が▲0.190~▲0.175%出合いと堅調に推移した。また、3M物は▲0.158~▲0.155%出合いと横ばい圏内で推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は機械やノンバンク等の業態で大口の調達が見られ、償還総額750億円程度に対し、発行総額は2,200億円程度まで膨らんだ。発行レートについては、引続き0%近辺で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/6/5	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	▲ 0.054				-	▲ 0.086	▲ 0.130	▲ 0.025	20,776.10	367.56	108.25-26	108.24-25
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.030				-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.095						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.107						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.158	▲ 0.129						
6M							▲ 0.178	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.158						
									日付	5/29	5/30	5/31	6/3	6/4
									日銀当預残	3,999,300	3,998,200	3,999,000	3,971,600	3,933,500
									準備預金残	3,494,200	3,493,000	3,490,500	3,485,800	3,438,900
									マネタリーベース	5,118,900	5,117,900	5,118,200	5,089,500	5,050,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.044%	▲ 0.051%	▲ 0.059%	▲ 0.060%	▲ 0.057%
									コール市場残高	103,368	105,273	102,486	94,516	100,520
									うち無担	83,746	86,302	80,506	75,534	79,891
									うちO/N	51,061	54,687	49,601	46,279	49,716
									うち有担	19,622	18,971	21,980	18,982	20,629

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/6/14	2019/12/13	259,182.0	10,500.03		0.0000%	4.0513%		0.0000%	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,756	2019/6/5	2019/6/6		3	3		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2019/6/5	2019/6/6		0	0				

●2019年6月6日の予定

*黒田日銀総裁、国際金融協会春季総会において講演	*ECB定例理事会(金融政策発表) *米国4月の貿易収支 *ユーロ圏1-3月期のGDP確報値	*国庫短期証券(836回)入札(6ヶ月、23,000億円、6/10発行) *流動性供給入札(5,000億円、6/7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