

Central Daily Market Report

2019年6月6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6月6日 需給速報	2019年6月7日 需給予想	2019年6月10日 当社予想			
銀行券	▲ 100	300	1,000			
財政	3,100	▲ 300	▲ 3,000			
資金過不足	3,000	0	▲ 2,000			
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						▲ 2,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200	2,500	▲ 400		
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		400			
国債補完供給						
当預増減	2,900	2,500	▲ 4,700			
当座預金残高	3,920,000	3,922,500	3,917,800			
準備預金残高	3,448,700					
積み終了先	3,448,500			6月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,448,500			積数	1,400	
非準備預金先	471,300			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	99.96%	日数	70.97%		

●2019年6月6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▲0.070~▲0.045%と横ばい圏での出合いとなった。▲0.065~▲0.045%のレンジで立ち上がり、出合い一巡後は▲0.070%で調整の出合いが見られた。ターム物に関してはロール案件の出合いが見られた程度であった。

<レポ市場>

GCT/N(6/7-6/10)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、小幅低下した。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.170~▲0.168%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1654%、按分落札利回▲0.1614%と、前回債からレートが低下する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.175~▲0.170%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.155%で、1Y物が▲0.200~▲0.190%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。発行市場は、鉄鋼、石油・石炭業態でまとまった額の発行がみられたものの、発行総額は1,700億円程度と償還総額1,900億円程度を下回った。発行レートに変化は見られず、引続き低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/6/6	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	▲ 0.053				-	▲ 0.082	▲ 0.125	0.005	20,774.04	▲ 2.06	108.32-33	108.23-24
T/N							-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.025	▲ 0.036				-	▲ 0.090						
2W							-	▲ 0.101						
3W			▲ 0.045				-	▲ 0.109						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.155	▲ 0.130						
6M							▲ 0.175	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.194	▲ 0.157						
									日付	5/30	5/31	6/3	6/4	6/5
									日銀当預残	3,998,200	3,999,000	3,971,600	3,933,500	3,917,100
									準備預金残	3,493,000	3,490,500	3,485,800	3,438,900	3,427,300
									マネタリーベース	5,117,900	5,118,200	5,089,500	5,050,500	5,033,200
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.059%	▲0.060%	▲0.057%	▲0.054%
									コール市場残高	105,273	102,486	94,516	100,520	99,868
									うち無担	86,302	80,506	75,534	79,891	79,638
									うちO/N	54,687	49,601	46,279	49,716	49,983
									うち有担	18,971	21,980	18,982	20,629	20,230

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
国庫短期証券	836	-	23,000	2019/6/10	2019/12/10	78,789.0	18,781.6	100.0810	▲0.1614%	67.0644%	100.0830	▲0.1654%	4,218.0
流動性供給	287	-	5,000	2019/6/7		10,013.0	4,990.00		0.0140%	92.9951%		0.0080%	

●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)	74,917	2019/6/6	2019/6/7		1	1		▲0.600	▲0.600	

●2019年6月7日の予定

- *黒田日銀総裁、G20/GPFIフォーラムにおいて講演
- *5月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *4月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+2.6%)
- *4月の毎月勤労統計調査速報 *4月の景気動向指数速報
- *米国4月の卸売売上高
- *米国4月の消費者信用残高
- *米国5月の雇用統計
- *国庫短期証券(837回)入札(3ヶ月、43,000億円、6/10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