

Central Daily Market Report

2019年6月7日(金)

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7日		2019年6月10日		2019年6月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		900		0	
財政	▲ 100		▲ 10,300		3,000	
資金過不足	300		▲ 9,400		3,000	
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			2,500	▲ 2,700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,900			
CP等買入	2,500	▲ 400		▲ 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						
E T F 買入	400					
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	2,700		▲ 1,700		3,000	
当座預金残高	3,922,700		3,921,000		3,924,000	
準備預金残高	3,442,200					
積み終了先	3,442,000				6月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,442,000				積数	
非準備預金先	480,500				1日平均	
					100	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,198,000	
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	80.65%		

●2019年6月7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▲0.065~▲0.045%と横ばい圏での出合いとなった。特段調整を急ぐ動きは見られず、昨日と横ばい圏の狭いレンジで推移した。ターム物はロール案件中心に散発的な出合いが見られた。固定金利方式による共通担保資金供給オペは2W物が15,000億円オファーされた。結果は2,493億円の応札となった。

<レポ市場>

GCT/N(6/10-6/11)は、▲0.10~▲0.085%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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.150~▲0.145%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1443%、按分落札利回▲0.1363%と、WI取引の小甘い出合いを反映し、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.147~▲0.145%出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行案件は1件のみと閑散なマーケットとなった。発行総額は50億円弱にとどまる一方、1,000億円弱の大型の期落ちがあったことが影響し、償還総額は1,600億円程度と大幅償還超となった。発行レートに特段の変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/6/7	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				-	▲ 0.083	▲ 0.120	0.005	20,884.71	110.67	108.45-47	108.46-47
T/N							-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.096						
2W							-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.122						
1M							-	▲ 0.127						
3M							▲ 0.147	▲ 0.130						
6M							▲ 0.175	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.157						
									日付	5/31	6/3	6/4	6/5	6/6
									日銀当預残	3,999,000	3,971,600	3,933,500	3,917,100	3,920,000
									準備預金残	3,490,500	3,485,800	3,438,900	3,427,300	3,448,800
									マネタリーベース	5,118,200	5,089,500	5,050,500	5,033,200	5,036,200
									無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.060%	▲0.057%	▲0.054%	▲0.053%
									コール市場残高	102,486	94,516	100,520	99,868	98,990
									うち無担	80,506	75,534	79,891	79,638	78,889
									うちO/N	49,601	46,279	49,716	49,983	49,509
									うち有担	21,980	18,982	20,629	20,230	20,101

●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)
国庫短期証券	837	-	43,000	2019/6/10	2019/9/9	113,265.0	35,544.5	100.0340	▲0.1363%	51.9280%	100.0360	▲0.1443%	7,455.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/6/10	2019/6/24		2,493	2,493				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/6/10			13,291	4,800	▲0.003		▲0.003	96.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2019/6/10			4,578	2,003	▲0.011		▲0.008	20.0
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/6/10			1,335	404	▲0.019		▲0.016	7.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	89,066	2019/6/7	2019/6/10		125	125		▲0.600	▲0.600	

●2019年6月10日の予定

- *1-3月期のGDP 2次速報(市場予想：前期比年率+2.1%)
- *4月の国際収支
- *4月の特定サービス産業動態統計速報
- *5月の景気ウォッチャー調査

◆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