

Central Daily Market Report

2019年6月10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10日 需給速報	2019年6月11日 需給予想	2019年6月12日 当社予想
銀行券	800	500	0
財政	▲ 5,500	2,000	▲ 6,000
資金過不足	▲ 4,700	2,500	▲ 6,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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	7,900	
CP等買入		▲ 100	▲ 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		700	
国債補完供給	▲ 100	100	100
当預増減	2,900	11,100	▲ 6,000
当座預金残高	3,925,600	3,936,700	3,930,700
準備預金残高	3,444,400		
積み終了先	3,444,200		
超過準備	3,444,200		
非準備預金先	481,200		
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	99.98%	日数
			83.87%

●2019年6月10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▲0.086~▲0.050%の出会いとなった。先週末の地合いを引き継ぎ▲0.055%で寄り付き後は、▲0.070~▲0.050%と横ばい圏で推移した。一巡後は調整から▲0.086%の出会いも見られた。ターム物に関しては特段目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(6/11-6/12)は、▲0.10~▲0.085%程度での出会い。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。アウトライ市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.177%、1Y物が▲0.195~▲0.193%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額800億円程度に対して、発行総額は950億円程度と若干の発行超であった。案件数が少なくやや閑散としたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/6/10	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.056				-	▲ 0.092	▲ 0.125	▲ 0.005	21,134.42	249.71	108.43-45	108.66-67
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.102						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.107						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.127						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.147	▲ 0.132						
6M							▲ 0.175	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.157						
									日付	6/3	6/4	6/5	6/6	6/7
									日銀当預残	3,971,600	3,933,500	3,917,100	3,920,000	3,922,700
									準備預金残	3,485,800	3,438,900	3,427,300	3,448,800	3,442,200
									マネタリーベース	5,089,500	5,050,500	5,033,200	5,036,200	5,038,500
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.057%	▲0.054%	▲0.053%	▲0.053%
									コール市場残高	94,516	100,520	99,868	98,990	105,844
									うち無担	75,534	79,891	79,638	78,889	84,510
									うちO/N	46,279	49,716	49,983	49,509	54,630
									うち有担	18,982	20,629	20,230	20,101	21,334

●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1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年超3年以下)	3,500	2019/6/11			15,218	3,507	▲0.005		▲0.004	65.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/6/11			12,901	4,006	▲0.011		▲0.010	55.1
国債買入(物価連動債)	250	2019/6/11			1,175	251	0.130		0.105	100.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	401,186	2019/6/10	2019/6/11		61	61		▲0.350	▲0.350	

●2019年6月11日の予定

*5月のマネーストック	*米国5月の生産者物価指数	*流動性供給入札(6,000億円、6/12発行)
		*エネルギー対策借入(7,500億円、6/20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