

Central Daily Market Report

2019年6月12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12日		2019年6月13日		2019年6月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 5,700		3,800		67,000	
資金過不足	▲ 5,600		3,000		66,000	
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						▲ 700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 600		▲ 100	2,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					900	▲ 2,300
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F 買入	700		100			
国債補完供給	▲ 800	200		800		
当預増減	▲ 1,200		3,700		66,400	
当座預金残高	3,931,000		3,934,700		4,001,100	
準備預金残高	3,426,000					
積み終了先	3,425,900					
超過準備	3,425,900					6月13日以降の残り所要積立額 積数 400
非準備預金先	505,000					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	99.99%	日数	90.32%		

●2019年6月12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▲0.080~▲0.045%の出会いとなった。立ち上がりは▲0.075~▲0.045%と昨日対比では取り手が増えたものの、横ばい圏で推移した。一巡後は▲0.080~▲0.060%で調整の出会いが見られた。ターム物に関してはロール案件中心に出会いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(6/13-6/14)は、▲0.115~▲0.075%程度での出会い。業者の売物多く、レートは上昇基調で推移した。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、40Y6~12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、レート上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.170%、1Y物が▲0.190%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額2,600億円程度に対して、発行総額は1,700億円程度と償還超であった。一部のゴム製品業態から大型の発行が見られ案件数が膨らんだものの、小型案件が中心となる落ち着いたマーケットであった。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

2019/6/12	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	▲ 0.058				-	▲ 0.103	▲ 0.115	0.000	21,129.72	▲ 74.56	108.48-49	108.31-32
T/N							-	▲ 0.113						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.120						
2W	▲ 0.050	▲ 0.020	▲ 0.030				-	▲ 0.124						
3W							-	▲ 0.133						
1M							-	▲ 0.134						
3M							▲ 0.145	▲ 0.133						
6M							▲ 0.170	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.157						
									日付	6/5	6/6	6/7	6/10	6/11
									日銀当預残	3,917,100	3,920,000	3,922,700	3,925,600	3,932,200
									準備預金残	3,427,300	3,448,800	3,442,200	3,444,400	3,441,500
									マネタリーベース	5,033,200	5,036,200	5,038,500	5,040,600	5,046,800
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.053%	▲0.053%	▲0.056%	▲0.057%
									コール市場残高	99,868	98,990	105,844	100,177	104,002
									うち無担	79,638	78,889	84,510	80,363	83,933
									うちO/N	49,983	49,509	54,630	49,783	53,653
									うち有担	20,230	20,101	21,334	19,814	20,069

●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	応募総額(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)	107,030	2019/6/12	2019/6/13		791	791		▲0.350	▲0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第98回 2019/6/14	2020/6/12	0	494
被災地金融支援オペ(熊本)	第37回 2019/6/14	2020/6/12	0	369

●2019年6月13日の予定

*4-6月期の法人企業景気予測調査季報	*30年利付国債入札 (7,000億円、6/14発行)
*4月の第3次産業活動指数	*交付税特別会計借入 (10,500億円、6/21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