

# Central Daily Market Report

2019年6月11日(火)

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11日		2019年6月12日		2019年6月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		200		▲ 1,000	
財政	▲ 2,200		▲ 5,500		3,000	
資金過不足	▲ 1,800		▲ 5,300		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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	7,900					
CP等買入		▲ 100		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F 買入	700		700			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	6,600		▲ 100		2,000	
当座預金残高	3,932,200		3,932,100		3,934,100	
準備預金残高	3,443,300					
積み終了先	3,443,100				6月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,443,100				積数	
非準備預金先	488,900				1日平均	
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	87.10%		

## ●2019年6月11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~▲0.050%の出会いとなった。立ち上がりは▲0.070~▲0.050%と概ね横ばい圏で推移。一巡後は調整から▲0.080~▲0.075%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散発的な出会いが見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(6/12-6/13)は、▲0.14~▲0.095%程度での出会い。売りが見え辛い局面ではレートが低下しての出会いが見られていた。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、40Y6~11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、低下した。アウトライト市場では、短国買入オペが5,000億円(前回比+2,500億円)でオファーされた。応札額が2兆1,156億円と多く、平均落札利回較差+0.011%、按分落札利回較差+0.006%と、在庫調整の売りから弱めの結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.145%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750億円程度に対して、発行総額は1,150億円程度と発行超であった。一部の小売業態から大型の発行が見られたものの、案件数少なく比較的閑散な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。本日はCP等買入オペが2,500億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.002%・按分▲0.003%と、前回(平均0.001%・按分▲0.001%)比で平均・按分共に低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/6/11	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	▲ 0.057				-	▲ 0.097	▲ 0.115	0.010	21,204.28	69.86	108.36-37	108.60-61
T/N							-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W			0.001				-	▲ 0.112						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.118						
3W			0.025				-	▲ 0.131						
1M							-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.145	▲ 0.133						
6M							▲ 0.170	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.157						
									日付	6/4	6/5	6/6	6/7	6/10
									日銀当預残	3,933,500	3,917,100	3,920,000	3,922,700	3,925,600
									準備預金残	3,438,900	3,427,300	3,448,800	3,442,200	3,444,400
									マネタリーベース	5,050,500	5,033,200	5,036,200	5,038,500	5,040,600
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.054%	▲0.053%	▲0.053%	▲0.056%
									コール市場残高	100,520	99,868	98,990	105,844	100,177
									うち無担	79,891	79,638	78,889	84,510	80,363
									うちO/N	49,716	49,983	49,509	54,630	49,783
									うち有担	20,629	20,230	20,101	21,334	19,814

## ●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)
流動性供給	288	-	6,000	2019/6/12		18,303.0	5,988.0	0.0130	12.2659%		0.0100		
エネルギー対策	-	-	7,500	2019/6/20	2020/6/22	151,302.0	7,499.94		0.0000%	4.9570%		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
国庫短期証券買入	5,000	2019/6/12			21,156	5,006	0.006		0.011	6.2
CP等買入	2,500	2019/6/14			5,822	2,480	▲0.003		▲0.002	80.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	109,745	2019/6/11	2019/6/12		91	91		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	34,837	2019/6/11	2019/6/12		135	135		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/6/13	2019/6/20	2.87	0	0				

## ●2019年6月12日の予定

\*4月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲0.8%)  
\*5月の企業物価指数

\*米国5月の財政収支  
\*米国5月の消費者物価指数

◆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