

Central Daily Market Report

2019年6月14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14日		2019年6月17日		2019年6月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		100		0	
財政	66,300		3,200		2,000	
資金過不足	66,000		3,300		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	600	▲ 700				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			6,000			
CP等買入	2,500	▲ 200		▲ 200		
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		▲ 200		▲ 100		
E T F 買入	800		700			
国債補完供給	▲ 100	400		100		
当預増減	67,700		9,800		2,000	
当座預金残高	4,002,600		4,012,400		4,014,400	
準備預金残高	3,499,300					
積み終了先	3,499,300					
超過準備	3,499,200					
非準備預金先	503,300					
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,090,900	
準備預金進捗率	実績	82.35%	日数	3.33%		

●2019年6月14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。年金定時払いにあたる積み最終日となるが、取り手が比較的しっかりとしており、立ち上がりは▲0.070~▲0.050%のレンジで推移。一巡後は調整で▲0.080~▲0.075%の出会いが見られた。後場にかけても調整の出会いが散見された。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(6/17-6/18)は、▲0.115~▲0.09%程度のお合い。T/Nは新積み期入りしての取引となるが、TDB3M物の発行もあり、レートは上昇傾向で推移した。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、低水準で推移した。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%から▲0.1575%まで買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1483%、按分落札利回▲0.1407%とWI取引ほどの強さは見られない結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.140~▲0.139%での出会いと按分レート近辺で推移した。この他に、6M物が▲0.170%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1,100億円程度に対して、発行総額は1,050億円程度と若干の償還超であった。一部の卸売業態から大型の発行が見られたものの、案件数が少なく閑散な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

2019/6/14	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.061				-	▲ 0.093	▲ 0.130	▲ 0.014	21,116.89	84.89	108.32-34	108.20-21
T/N							-	▲ 0.112						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.030	▲ 0.049				-	▲ 0.120						
2W	▲ 0.075	▲ 0.060	▲ 0.069				-	▲ 0.138						
3W							-	▲ 0.132						
1M							-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.140	▲ 0.133						
6M							▲ 0.170	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.188	▲ 0.157						
									日付	6/7	6/10	6/11	6/12	6/13
									日銀当預残	3,922,700	3,925,600	3,932,200	3,931,000	3,934,900
									準備預金残	3,442,200	3,444,400	3,441,500	3,426,000	3,438,100
									マネタリーベース	5,038,500	5,040,600	5,046,800	5,045,400	5,050,200
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.056%	▲0.057%	▲0.058%	▲0.057%
									コール市場残高	105,844	100,177	104,002	110,320	115,135
									うち無担	84,510	80,363	83,933	88,333	90,778
									うちO/N	54,630	49,783	53,653	56,553	58,488
									うち有担	21,334	19,814	20,069	21,987	24,357

●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	838	-	43,300	2019/6/17	2019/9/17	127,848.0	35,808.4	100.0355	▲0.1407%	41.6558%	100.0374	▲0.1483%	7,491.0

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/6/17			10,488	4,804	▲0.011		▲0.007	9.5
国債買入(変動利付債)	1,000	2019/6/17			3,863	1,005	▲0.180		▲0.200	74.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	188,379	2019/6/14	2019/6/17		86	86		▲0.350	▲0.350	

●2019年6月17日の予定

*4月の石油等消費動態統計

◆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