

Central Daily Market Report

2019年6月18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18日		2019年6月19日		2019年6月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 500		▲ 2,000	
財政	4,000		▲ 20,700		82,000	
資金過不足	3,800		▲ 21,200		80,000	
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			2,500			
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			28,000	▲ 26,100		
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入	1,000					
国債補完供給		300				
当預増減	4,900		▲ 16,900		80,000	
当座預金残高	4,016,600		3,999,700		4,079,700	
準備預金残高	3,489,100					
積み終了先	3,450,700					
超過準備	3,433,000					
非準備預金先	527,500					
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	98.45%	日数	10.00%		

●2019年6月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀を中心に▲0.075~▲0.060%での調達で始まった。積みの序盤ということもあり、調達サイドから取り急ぐ動きは見られず、一巡後は▲0.075~▲0.070%程度の出合いが見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GCT/N(6/19-6/20)は、▲0.105~▲0.090%程度の出合い。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10Y336~354、5Y134~139、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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回と同額)でオファーされた。オペ通告後に、3M物で▲0.135%、6M物で▲0.164~▲0.162%、1Y物で▲0.179%の出合いが見られる中、平均落札利回較差+0.018%、按分落札利回較差+0.015%と、マーケットの小甘い出合いを反映してか弱めの結果となった。後場は、店頭での買いもあってか6M物が▲0.178%まで買い進まれるなど強含みで推移した。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は五・十日発行にあたり、2,500億円程の償還に対して、2,700億円程の発行が見られた。石油・鉄鋼業態等からはまとまったロットでの発行が行われた。発行レートは概ね横ばいであったものの、一部期越えの案件ではレートが若干低下する局面も見られた。

●短期金融市場関連指標

2019/6/18	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	▲ 0.068				-	▲ 0.097	▲ 0.130	0.000	20,972.71	▲ 151.29	108.54-55	108.25-26
T/N							-	▲ 0.105						
S/N			0.001				-	-						
1W	▲ 0.070	0.230	▲ 0.022				-	▲ 0.110						
2W							-	▲ 0.129						
3W							-	▲ 0.127						
1M							-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.138	▲ 0.131						
6M							▲ 0.172	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.182	▲ 0.157						
									日付	6/11	6/12	6/13	6/14	6/17
									日銀当預残	3,932,200	3,931,000	3,934,900	4,002,600	4,011,700
									準備預金残	3,441,500	3,426,000	3,438,100	3,497,800	3,489,700
									マネタリーベース	5,046,800	5,045,400	5,050,200	5,118,100	5,127,100
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.058%	▲0.057%	▲0.061%	▲0.067%
									コール市場残高	104,002	110,320	115,135	109,805	100,472
									うち無担	83,933	88,333	90,778	85,087	79,124
									うちO/N	53,653	56,553	58,488	56,807	47,334
									うち有担	20,069	21,987	24,357	24,718	21,348

●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)
5年利付国債	139	0.10%	19,000	2019/6/19	2024/3/20	71,452.0	15,843.00	101.5700	▲0.2260%	97.7373%	101.5800	▲0.2280%	3,150.0

●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
国庫短期証券買入	2,500	2019/6/19			11,008	2,504	0.015		0.018	69.4
社債等買入	1,250	2019/6/24			2,918	1,250	▲0.027		0.032	29.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	225,756	2019/6/18	2019/6/19		17	17		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/6/20	2019/6/27	2.85	1	1				

●2019年6月19日の予定

*衛藤日銀理事、全国信用金庫大会において講演	*米国FOMC(2日目)	*国庫短期証券(839回)入札
*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、20日まで)	*米国FRB経済見通し発表	(1年、19,000億円、6/20発行)
*5月の貿易統計	*英国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