

# Central Daily Market Report

2019年6月19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19日		2019年6月20日		2019年6月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,800		▲ 2,000	
財政	▲ 20,800		83,100		0	
資金過不足	▲ 21,300		81,300		▲ 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	2,500					
国債買入			3,500			
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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				▲ 1,300		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 300			300		
当預増減	▲ 17,300		83,600		▲ 2,000	
当座預金残高	3,999,300		4,082,900		4,080,900	
準備預金残高	3,480,700					
積み終了先	3,462,000				6月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,454,900				積数	
非準備預金先	518,600				1日平均	
					900	
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	99.28%	日数	13.33%		

## ●2019年6月19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▲0.080~▲0.060%近辺の調達で始まった。一巡後は調達サイドの目途が付き、▲0.08%で調整の出合いが散見された。ターム物に関しては月内物のショートタームで出合いが見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(6/20-6/21)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。アウトライク市場では、1Y物の入札が実施された。債券相場全体が強含みで推移する中、WI取引において▲0.180%での出合いも見られ、平均落札利回▲0.2068%、按分落札利回▲0.1851%と事前予想より強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.250%と強めの出合いも見られたものの、大きくレートが低下したことで参加者は少なく、閑散だった。この他に、3M物が▲0.138~▲0.135%、6M物が▲0.200%で出合った。

### <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3,200億円程度の償還に対して、1,900億円程度の発行にとどまり、商社などからは大型の発行が見られたものの、償還超のマーケットになった。発行レートは前日から特段の変動は見られていない。

## ●短期金融市場関連指標

2019/6/19	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	▲ 0.069				-	▲ 0.097	▲ 0.140	▲ 0.010	21,333.87	361.16	108.57-59	108.38-39
T/N							-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.040	▲ 0.046				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.018				-	▲ 0.123						
3W							-	▲ 0.123						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.138	▲ 0.130						
6M							▲ 0.200	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.250	▲ 0.157						
									日付	6/12	6/13	6/14	6/17	6/18
									日銀当預残	3,931,000	3,934,900	4,002,600	4,011,700	4,016,600
									準備預金残	3,426,000	3,438,100	3,497,800	3,489,700	3,489,100
									マネタリーベース	5,045,400	5,050,200	5,118,100	5,127,100	5,132,300
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.057%	▲0.061%	▲0.067%	▲0.068%
									コール市場残高	110,320	115,135	109,805	100,472	100,055
									うち無担	88,333	90,778	85,087	79,124	81,525
									うちO/N	56,553	58,488	56,807	47,334	47,815
									うち有担	21,987	24,357	24,718	21,348	18,530

## ●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	839	-	19,000	2019/6/20	2020/6/22	86,637.0	15,677.9	100.1870	▲0.1851%	6.0233%	100.2090	▲0.2068%	3,322.0

## ●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1年以下)	500	2019/6/20			1,068	501	0.015		0.018	79.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2019/6/20			7,294	2,005	▲0.022		▲0.020	75.4
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/6/20			1,863	403	▲0.027		▲0.026	63.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	300,796	2019/6/19	2019/6/20		223	223		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年6月20日の予定

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)  
\*黒田日銀総裁定例会見

\*英中銀MPC結果発表

◆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