

Central Daily Market Report

2019年6月20日(木)

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20日		2019年6月21日		2019年6月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,900		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	85,300		5,500		▲ 1,000	
資金過不足	83,400		4,400		▲ 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						▲ 2,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	3,500					
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 1,300		▲ 100	1,300	
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当預増減	85,600		4,100		▲ 3,200	
当座預金残高	4,084,900		4,089,000		4,085,800	
準備預金残高	3,545,400					
積み終了先	3,542,700					
超過準備	3,538,300				6月21日以降の残り所要積立額 積数 15,100	
非準備預金先	539,500				1日平均 600	
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	99.51%	日数	16.67%		

●2019年6月20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▲0.075~▲0.060%の出会いが中心となった。一巡後は調整から▲0.075~▲0.070%程度の出会いが散見された程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で散発的に出会いが見られていた。

<レポ市場>

GCT/N(6/21-6/24)は、▲0.095~▲0.085%程度のお合い。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、低水準で推移した。アウトライト市場は、前日に大幅にレート低下したこともあってか、全般的に閑散で、引け際に6M物が▲0.200%で出合った程度であった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は償還3,300億円程に対して、発行2,800億円程の償還超。鉄鋼・機械・石油業態からは大ロットでの発行が実施された。発行レートは引き続き0%付近での決着が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2019/6/20	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.093	▲ 0.170	▲ 0.030	21,462.86	128.99	108.10-12	107.67-68
T/N			▲ 0.075				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.070				-	▲ 0.098						
2W							-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.138	▲ 0.130						
6M							▲ 0.200	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.240	▲ 0.159						
									日付	6/13	6/14	6/17	6/18	6/19
									日銀当預残	3,934,900	4,002,600	4,011,700	4,016,600	3,999,300
									準備預金残	3,438,100	3,497,800	3,489,700	3,489,100	3,480,700
									マネタリーベース	5,050,200	5,118,100	5,127,100	5,132,300	5,115,400
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.061%	▲0.067%	▲0.068%	▲0.069%
									コール市場残高	115,135	109,805	100,472	100,055	101,109
									うち無担	90,778	85,087	79,124	81,525	81,309
									うちO/N	58,488	56,807	47,334	47,815	46,739
									うち有担	24,357	24,718	21,348	18,530	19,800

●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	オフター額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)	386,958	2019/6/20	2019/6/21		54	54		▲0.350	▲0.350	

●2019年6月21日の予定

*5月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.8%)

*米国5月の中古住宅販売

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。

(1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2)

短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて

上下にある程度変動しうるものとし(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する)、

買入れ額については、保有残高の増加額年間約80兆円をめどとしつつ、弾力的な買入れを実施する。

(2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)

①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。

その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうるものとする。

②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

◆本資料は信頼できるとさ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