

Central Daily Market Report

2019年6月21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21日		2019年6月24日		2019年6月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 700		▲ 1,000	
財政	5,900		400		2,000	
資金過不足	4,700		▲ 300		1,000	
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			3,700	▲ 2,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,800			
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 100	1,300			
E T F 買入			900			
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	4,100		15,900		1,000	
当座預金残高	4,089,000		4,104,900		4,105,900	
準備預金残高	3,586,200					
積み終了先	3,584,000				6月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,583,800				積数	
非準備預金先	502,800				1日平均	
					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	99.75%	日数	26.67%		

●2019年6月21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~▲0.065%の出会いが中心となった。週末を跨ぐ取引ではあったものの特段取り急ぐ動きは見られず、一巡後は調整から▲0.075~▲0.060%程度の出会い水準で推移し、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、月内の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(6/24-6/25)は、▲0.090~▲0.080%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、3M物の入札が実施された。WI取引において玉確保ニーズから▲0.145~▲0.135%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1384%、按分落札利回▲0.1288%と、業者の在庫の積み上がりりを反映してかテールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.130~▲0.129%出合いと按分レート近辺で推移した。

<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、発行・償還ともに2,300億円程度の規模となった。大型発行は鉄鋼・小売業態等から実施された。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2019/6/21	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	▲ 0.067				-	▲ 0.093	▲ 0.170	0.000	21,258.64	▲ 204.22	107.30-31	107.45-46
T/N			▲ 0.075				-	▲ 0.090						
S/N			▲ 0.075				-	-						
1W	▲ 0.080	0.000	▲ 0.063				-	▲ 0.102						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.105						
3W			▲ 0.045				-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.130	▲ 0.129						
6M							▲ 0.200	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.240	▲ 0.159						
									日付	6/14	6/17	6/18	6/19	6/20
									日銀当預残	4,002,600	4,011,700	4,016,600	3,999,300	4,084,900
									準備預金残	3,497,800	3,489,700	3,489,100	3,480,700	3,545,400
									マネタリーベース	5,118,100	5,127,100	5,132,300	5,115,400	5,203,000
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.067%	▲0.068%	▲0.069%	▲0.086%
									コール市場残高	109,805	100,472	100,055	101,109	108,501
									うち無担	85,087	79,124	81,525	81,309	86,698
									うちO/N	56,807	47,334	47,815	46,739	52,218
									うち有担	24,718	21,348	18,530	19,800	21,803

●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)	募入最低値	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	840	-	42,700	2019/6/24	2019/9/24	116,458.0	35,315.6	100.0325	▲0.1288%	48.1250%	100.0349	▲0.1384%	7,384.0

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	15,000	2019/6/24	2019/7/8		3,666	3,666				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/6/24			9,629	3,502	▲0.007		▲0.004	72.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/6/24			9,635	4,000	▲0.032		▲0.020	20.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/6/24			10,616	4,802	▲0.021		▲0.015	9.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	125,108	2019/6/21	2019/6/24		290	290		▲0.350	▲0.350	

●2019年6月24日の予定

*4月の景気動向指数改訂状況

◆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