

Central Daily Market Report

2019年6月25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25日		2019年6月26日		2019年6月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,200		▲ 1,000	
財政	4,900		▲ 10,800		▲ 3,000	
資金過不足	3,900		▲ 12,000		▲ 4,000	
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			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200		▲ 100		
E T F 買入			300			
国債補完供給		600				
当預増減	3,800		▲ 6,900		▲ 4,000	
当座預金残高	4,106,900		4,100,000		4,096,000	
準備預金残高	3,596,900					
積み終了先	3,596,100				6月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,596,000				積数 5,700	
非準備預金先	510,000				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	99.82%	日数	33.33%		

●2019年6月25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▲0.070~▲0.065%近辺の調達で始まった。引き続き調達ニーズが弱い状況に変化はなく、一巡後は▲0.070%近辺の出会いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、特段出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(6/26-6/27)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、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5,000億円(前回比+2,500億円)でオファーされた。応札額が2兆2,566億円と多く、平均落札利回較差+0.023%、按分落札利回較差+0.017%と、在庫調整の売りから弱めの決着となった。マーケットでは、引け際に6M物が▲0.205~▲0.200%で、1Y物が▲0.230%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。電力、食品等から大型案件が見られ発行は2,500億円程度まで膨らんだものの、償還が3,800億円程度あり、償還超となった。発行レートは一部月末越えのショートターム物で低下する銘柄があったが、その他は概ね0%近辺で推移した。本日はCP等買入オペが2,500億円オファーされた。結果は按分落札レート▲0.003%、平均落札レート0.002%と按分レートは前回比横ばい、平均レートは前回(▲0.002%)比で上昇した。

●短期金融市場関連指標

2019/6/25	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	▲ 0.066				-	▲ 0.088	▲ 0.157	▲ 0.001	21,193.81	▲ 92.18	107.33-34	107.04-05
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.098						
2W							-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.106						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.135	▲ 0.124						
6M							▲ 0.205	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.230	▲ 0.159						
									日付	6/18	6/19	6/20	6/21	6/24
									日銀当預残	4,016,600	3,999,300	4,084,900	4,089,000	4,103,100
									準備預金残	3,489,100	3,480,700	3,545,400	3,586,200	3,600,300
									マネタリーベース	5,132,300	5,115,400	5,203,000	5,208,300	5,223,400
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.069%	▲0.086%	▲0.067%	▲0.066%
									コール市場残高	100,055	101,109	108,501	113,730	115,952
									うち無担	81,525	81,309	86,698	91,345	93,555
									うちO/N	47,815	46,739	52,218	54,915	56,665
									うち有担	18,530	19,800	21,803	22,385	22,397

●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)
20年利付国債	168	0.40%	9,000	2019/6/26	2039/3/20	30,433.0	7,455.00	103.5500	0.2120%	25.6662%	103.6300	0.2080%	1,537.0

●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	5,000	2019/6/26			22,566	5,000	0.017		0.023	21.9
CP等買入	2,500	2019/6/28			5,695	2,480	▲0.003		0.002	29.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	125,211	2019/6/25	2019/6/26		16	16		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/6/27	2019/7/5	2.89	0	0				

●2019年6月26日の予定

*米国5月の耐久財新規受注

◆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