

Central Daily Market Report

2019年6月26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26日 需給速報	2019年6月27日 需給予想	2019年6月28日 当社予想			
銀行券	▲ 1,300	▲ 2,200	▲ 500			
財政	▲ 9,500	4,800	4,900			
資金過不足	▲ 10,800	2,600	4,400			
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			7,900			
CP等買入		▲ 100	▲ 800	2,500		
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				
E T F 買入	300					
国債補完供給						
当預増減	▲ 5,700	9,700	6,900			
当座預金残高	4,101,200	4,110,900	4,117,800			
準備預金残高	3,578,100					
積み終了先	3,577,500					
超過準備	3,577,500			6月27日以降の残り所要積立額 積数	5,100	
非準備預金先	523,100			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	99.83%	日数	36.67%		

●2019年6月26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~▲0.065%近辺の調達で始まった。資金調達意欲は引き続き弱く、一巡後は▲0.075~▲0.070%前後の出合いが見られた。ターム物に関しては、特段出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(6/27-6/28)は、▲0.095~▲0.085%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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に6M物が▲0.200%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。発行市場は月末スタートの発行が8,500億円程度に膨らんだものの、四半期末の有利子負債削減から償還は2兆8,000億円程度と大幅な償還超となった。発行レートは一部ショートターム物で低下する銘柄も見られたが概ね0%近辺で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/6/26	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				-	▲ 0.086	▲ 0.150	0.007	21,086.59	▲ 107.22	107.17-18	107.45-47
T/N							-	▲ 0.087						
S/N			0.010				-	-						
1W							-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.019				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.134	▲ 0.122						
6M							▲ 0.200	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.225	▲ 0.159						
									日付	6/19	6/20	6/21	6/24	6/25
									日銀当預残	3,999,300	4,084,900	4,089,000	4,103,100	4,106,900
									準備預金残	3,480,700	3,545,400	3,586,200	3,600,300	3,596,900
									マネタリーベース	5,115,400	5,203,000	5,208,300	5,223,400	5,228,200
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.086%	▲0.067%	▲0.066%	▲0.066%
									コール市場残高	101,109	108,501	113,730	115,952	123,032
									うち無担	81,309	86,698	91,345	93,555	99,155
									うちO/N	46,739	52,218	54,915	56,665	62,885
									うち有担	19,800	21,803	22,385	22,397	23,877

●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年超3年以下)	3,500	2019/6/27			13,796	3,506	0.006		0.006	97.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/6/27			20,416	4,014	▲0.003		▲0.002	82.3
国債買入(物価連動債)	250	2019/6/27			1,572	250		▲0.160	▲0.210	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	189,868	2019/6/26	2019/6/27		1	1		▲0.350	▲0.350	

●2019年6月27日の予定

*若田部日銀副総裁、青森県金融経済懇談会において講演	*米国1-3月期のGDP確報値	*2年利付国債入札(20,000億円、7/1発行)
*1-3月期の資金循環統計速報		
*5月の商業動態統計速報		

◆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