

# Central Daily Market Report

2019年6月17日(月)  
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17日		2019年6月18日		2019年6月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 100				0
財政	2,800	3,500	▲ 25,000			
資金過不足	2,900	3,400	▲ 25,000			
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						
国債買入	6,000					
CP等買入		▲ 200	▲ 200			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					28,000	▲ 21,400
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入	700		1,000			
国債補完供給	▲ 300	100	300			
当預増減	9,100		4,500		▲ 18,400	
当座預金残高	4,011,700		4,016,200		3,997,800	
準備預金残高	3,489,700					
積み終了先	3,395,200					
超過準備	3,048,300					
非準備預金先	522,000					
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	96.64%	日数	6.67%		

## ●2019年6月17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~▲0.040%での調達で始まった。実質的な新しい積みの初日ということもあり、調達側から取り急ぐ姿は見られなかった。一巡後は▲0.080~▲0.040%程度で散発的な出合いが見られた。ターム物に関しては月内エンドのショートターム物で出合いが散見された。

### <レポ市場>

GCT/N(6/18-6/19)は、▲0.105~▲0.100%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。アウトライ市場は、動意なく閑散な中、引け際に1Y物が▲0.188%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、商社から大型発行が見られたが、1,300億円強の償還に対し、発行は700億円強にとどまった。発行レートは横ばい圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2019/6/17	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.067				-	▲ 0.095	▲ 0.130	0.000	21,124.00	7.11	108.57-58	108.56-57
T/N							-	▲ 0.109						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.040	▲ 0.064				-	▲ 0.115						
2W							-	▲ 0.136						
3W							-	▲ 0.130						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.128						
3M							▲ 0.140	▲ 0.132						
6M							▲ 0.170	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.188	▲ 0.157						
									日付	6/10	6/11	6/12	6/13	6/14
									日銀当預残	3,925,600	3,932,200	3,931,000	3,934,900	4,002,600
									準備預金残	3,444,400	3,441,500	3,426,000	3,438,100	3,497,800
									マネタリーベース	5,040,600	5,046,800	5,045,400	5,050,200	5,118,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.056%	▲ 0.057%	▲ 0.058%	▲ 0.057%	▲ 0.061%
									コール市場残高	100,177	104,002	110,320	115,135	109,805
									うち無担	80,363	83,933	88,333	90,778	85,087
									うちO/N	49,783	53,653	56,553	58,488	56,807
									うち有担	19,814	20,069	21,987	24,357	24,718

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	534,511	2019/6/17	2019/6/18		239	239		▲0.350	▲0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2019/6/19	2023/6/19	0
				28,033

## ●2019年6月18日の予定

*月例経済報告	*米国FOMC(1日目)	*5年利付国債入札(19,000億円、6/19発行)
	*米国5月の住宅着工件数	
	*ユーロ圏5月の消費者物価指数改定値	

◆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お客様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