

# Central Daily Market Report

2019年6月24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24日		2019年6月25日		2019年6月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,000		▲ 2,000	
財政	▲ 500		9,800		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 1,500		8,800		▲ 13,000	
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		▲ 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	1,300			▲ 200		
E T F 買入	900					
国債補完供給	▲ 600	300		600		
当預増減	14,100		8,700		▲ 13,000	
当座預金残高	4,103,100		4,111,800		4,098,800	
準備預金残高	3,600,300					
積み終了先	3,599,300					
超過準備	3,599,100					
非準備預金先	502,800					
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	99.79%	日数	30.00%		

## ●2019年6月24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~▲0.060%近辺の調達で始まった。先週末と同様に調達意欲は弱く、一巡後も調達側の参加者はほとんど現れず▲0.080~▲0.073%台で散発的な出合いが見られた程度であった。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

### <レポ市場>

GCT/N(6/25-6/26)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、全般的に閑散な中、引け際に3M物が▲0.134%、6M物が▲0.200~▲0.185%、1Y物が▲0.235~▲0.215%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、商社、機械、石油等から大型案件が見られ、2,700億円程度の償還に対して3,000億円程度の発行と発行超であった。発行レートは概ね0%近辺であった。

## ●短期金融市場関連指標

2019/6/24	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.092	▲ 0.156	0.014	21,285.99	27.35	107.30-31	107.41-42
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.099						
2W			0.010				-	▲ 0.102						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.107						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.130	▲ 0.127						
6M							▲ 0.200	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.220	▲ 0.159						
									日付	6/17	6/18	6/19	6/20	6/21
									日銀当預残	4,011,700	4,016,600	3,999,300	4,084,900	4,089,000
									準備預金残	3,489,700	3,489,100	3,480,700	3,545,400	3,586,200
									マネタリーベース	5,127,100	5,132,300	5,115,400	5,203,000	5,208,300
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.068%	▲0.069%	▲0.086%	▲0.067%
									コール市場残高	100,472	100,055	101,109	108,501	113,730
									うち無担	79,124	81,525	81,309	86,698	91,345
									うちO/N	47,334	47,815	46,739	52,218	54,915
									うち有担	21,348	18,530	19,800	21,803	22,385

## ●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)	381,311	2019/6/24	2019/6/25		280	280		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	8,041	2019/6/24	2019/6/25		271	271		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年6月25日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(4月24、25日分)	*米国4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*20年利付国債入札(9,000億円、6/26発行)
*5月の企業向けサービス価格指数	*米国5月の新築一戸建て販売件数	
	*米国6月のCB消費者信頼感指数	

◆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