

# Central Daily Market Report

2019年6月27日(木)

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27日		2019年6月28日		2019年7月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,200		▲ 1,000		0	
財政	4,600		2,300		▲ 27,000	
資金過不足	2,400		1,300		▲ 27,000	
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						▲ 600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,900					
CP等買入		▲ 800	2,500	▲ 2,800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給						
当預増減	9,500		1,000		▲ 27,600	
当座預金残高	4,110,700		4,111,700		4,084,100	
準備預金残高	3,585,300					
積み終了先	3,584,900					
超過準備	3,584,800				6月28日以降の残り所要積立額 積数 4,600	
非準備預金先	525,400				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	99.85%	日数	40.00%		

## ●2019年6月27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~▲0.070%近辺の調達で始まった。調達サイドの様子見姿勢から昨日同様に低調な地合いとなり、一巡後は▲0.08%台で散発的な出合いが見られた程度であった。ターム物に関しては7月スタートのショートターム物で出合いが見られていた。

### <レポ市場>

GCT/N(6/28-7/1)は、▲0.115~▲0.075%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▲0.195~▲0.185%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。発行市場は四半期末に残高を解消した先からの発行再開により1兆2,000億円程度まで膨らんだ(償還はなし)。大型案件は電機、鉄鋼、石油、商社、食品等幅広い業態から見られた。発行レートは概ね0%近辺で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/6/27	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	▲ 0.070				-	▲ 0.085	▲ 0.145	0.005	21,338.17	251.58	107.74-75	108.04-06
T/N							-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.045	▲ 0.048				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.070	▲ 0.025	▲ 0.055				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.103						
1M	▲ 0.065	▲ 0.020	▲ 0.044				-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.134	▲ 0.121						
6M							▲ 0.185	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.222	▲ 0.159						
									日付	6/20	6/21	6/24	6/25	6/26
									日銀当預残	4,084,900	4,089,000	4,103,100	4,106,900	4,101,200
									準備預金残	3,545,400	3,586,200	3,600,300	3,596,900	3,575,300
									マナタリベース	5,203,000	5,208,300	5,223,400	5,228,200	5,223,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.086%	▲ 0.067%	▲ 0.066%	▲ 0.066%	▲ 0.068%
									コール市場残高	108,501	113,730	115,952	123,032	121,536
									うち無担	86,698	91,345	93,555	99,155	94,762
									うちO/N	52,218	54,915	56,665	62,885	52,452
									うち有担	21,803	22,385	22,397	23,877	26,774

## ●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)
2年利付国債	402	0.10%	20,000	2019/7/1	2021/7/1	74,499.0	16,955.00	100.6250	▲0.2110%	63.7779%	100.6360	▲0.2160%	3,041.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	51,883	2019/6/27	2019/6/28		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	35,410	2019/6/27	2019/6/28		21	21		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年6月28日の予定

*G20大阪サミット(～29日まで)	*米国5月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(841回)入札
*決定会合における主な意見(6月19、20日分)	*米国6月のシカゴPM景況感指数	(3ヶ月、42,800億円、7/1発行)
*5月の完全失業率(市場予想:2.4%)	*英国1-3月期のGDP確報値	
*5月の有効求人倍率(市場予想:1.63倍)	*ユーロ圏6月の消費者物価指数速報値	
*5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.7%)		
*5月の住宅着工統計		
*6月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.9%)		

◆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