

# Central Daily Market Report

2019年6月28日(金)

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28日		2019年7月1日		2019年7月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		600		0	
財政	▲ 1,600		▲ 29,600		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 2,500		▲ 29,000		▲ 6,000	
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			700	▲ 600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,800			
CP等買入	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						
E T F 買入						
国債補完供給						
当預増減	▲ 2,800		▲ 21,100		▲ 6,000	
当座預金残高	4,107,900		4,086,800		4,080,800	
準備預金残高	3,584,500					
積み終了先	3,584,300		7月1日以降の残り所要積立額		積数 3,100	
超過準備	3,584,000				1日平均 200	
非準備預金先	523,400					
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,083,000	
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数	50.00%		

## ●2019年6月28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▲0.086~▲0.075%近辺の調達で始まった。四半期末を跨ぐ取引であることから、調達件数が少なく運用サイドが出し残る展開となった。一巡後は▲0.086%近辺の出合いが散見され、今月の取引を終えた。ターム物は、ショートタームを中心に出会いが見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(7/1-7/2)は、▲0.085~▲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、小幅上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.115%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1138%、按分落札利回▲0.1042%と、在庫の積み上がりもあってか、マーケットの慎重姿勢を反映して弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.107~▲0.106%出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、6M物が▲0.180~▲0.179%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。発行市場は案件は少なかったものの、商社、建設、石油等から大型案件が見られ、発行は2,000億円程度まで膨らんだ(償還200億円程度)。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

2019/6/28	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.076				-	▲ 0.088	▲ 0.165	▲ 0.020	21,275.92	▲ 62.25	107.75-77	107.63-65
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.072	0.000	▲ 0.055				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.065	▲ 0.005	▲ 0.057				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.100						
1M	▲ 0.065	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.106	▲ 0.123						
6M							▲ 0.177	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.222	▲ 0.158						
									日付	6/21	6/24	6/25	6/26	6/27
									日銀当預残	4,089,000	4,103,100	4,106,900	4,101,200	4,110,700
									準備預金残	3,586,200	3,600,300	3,596,900	3,575,300	3,587,900
									マネタリーベース	5,208,300	5,223,400	5,228,200	5,223,800	5,235,600
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.066%	▲0.066%	▲0.068%	▲0.070%
									コール市場残高	113,730	115,952	123,032	121,536	127,686
									うち無担	91,345	93,555	99,155	94,762	96,207
									うちO/N	54,915	56,665	62,885	52,452	54,547
									うち有担	22,385	22,397	23,877	26,774	31,479

## ●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)
国庫短期証券	841	-	42,800	2019/7/1	2019/9/30	167,105.5	35,639.7	100.0260	▲0.1042%	5.5546%	100.0284	▲0.1138%	7,160.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/7/1	2019/7/16		655	655				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/7/1			10,518	4,805	▲0.019		▲0.015	77.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2019/7/1			5,069	2,004	▲0.018		▲0.016	99.4
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/7/1			1,833	404	▲0.021		▲0.019	35.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	195,159	2019/6/28	2019/7/1		28	28		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,070	2019/6/28	2019/7/1		0	0				

## ●2019年7月1日の予定

*6月調査の日銀短観(概要及び要旨) 市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI):+9 *6月の消費動向調査	*米国5月の建設支出 *米国6月のISM製造業景況指数
--	--------------------------------

◆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