

# Central Daily Market Report

2019年6月12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12日<br>需給速報 | 2019年6月13日<br>需給予想 | 2019年6月14日<br>当社予想 |
|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 銀行券                     | 100                | ▲ 800              | ▲ 1,000            |
| 財政                      | ▲ 5,700            | 3,800              | 67,000             |
| 資金過不足                   | ▲ 5,600            | 3,000              | 66,000             |
| <b>金融調節</b>             |                    |                    |                    |
|                         | スタート               | エンド                | スタート               |
| 貸出                      |                    |                    |                    |
| 全店共通                    |                    |                    | ▲ 700              |
| 国債買現                    |                    |                    |                    |
| 国債売現                    |                    |                    |                    |
| 国庫短期証買入                 | 5,000              |                    |                    |
| 国債買入                    |                    |                    |                    |
| CP等買入                   |                    | ▲ 100              | 2,500              |
| 貸出支援基金(成)               |                    |                    |                    |
| 貸出支援基金(貸)               |                    |                    |                    |
| 被災地支援                   |                    |                    | 900                |
| 社債等買入                   |                    | ▲ 100              | ▲ 2,300            |
| E T F 買入                | 700                | 100                |                    |
| 国債補完供給                  | ▲ 800              | 200                | 800                |
| 当預増減                    | ▲ 1,200            | 3,700              | 66,400             |
| 当座預金残高                  | 3,931,000          | 3,934,700          | 4,001,100          |
| 準備預金残高                  | 3,426,000          |                    |                    |
| 積み終了先                   | 3,425,900          |                    |                    |
| 超過準備                    | 3,425,900          |                    |                    |
| 非準備預金先                  | 505,000            |                    |                    |
| 積み期間 (5/16~6/15) の所要準備額 |                    |                    | 3,198,000          |
| 準備預金進捗率                 | 実績                 | 99.99%             | 日数                 |
|                         |                    |                    | 90.32%             |

## ●2019年6月12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▲0.080~▲0.045%の出会いとなった。立ち上がりは▲0.075~▲0.045%と昨日対比では取り手が増えたものの、横ばい圏で推移した。一巡後は▲0.080~▲0.060%で調整の出会いが見られた。ターム物に関してはロール案件中心に出会いが見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(6/13-6/14)は、▲0.115~▲0.075%程度での出会い。業者の売物多く、レートは上昇基調で推移した。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10Y336~353、5Y129~136、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、レート上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.170%、1Y物が▲0.190%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額2,600億円程度に対して、発行総額は1,700億円程度と償還超であった。一部のゴム製品業態から大型の発行が見られ案件数が膨らんだものの、小型案件が中心となる落ち着いたマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

| 2019/6/12 | 無担(速報)  |         |         | 有担(速報) |    |    | 短国      | 東京<br>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   | ▲ 0.058 |        |    |    | -       | ▲ 0.103     | ▲ 0.115   | 0.000     | 21,129.72 | ▲ 74.56   | 108.48-49 | 108.31-32 |
| T/N       |         |         |         |        |    |    | -       | ▲ 0.113     |           |           |           |           |           |           |
| S/N       |         |         |         |        |    |    | -       | -           |           |           |           |           |           |           |
| 1W        |         |         | ▲ 0.025 |        |    |    | -       | ▲ 0.120     |           |           |           |           |           |           |
| 2W        | ▲ 0.050 | ▲ 0.020 | ▲ 0.030 |        |    |    | -       | ▲ 0.124     |           |           |           |           |           |           |
| 3W        |         |         |         |        |    |    | -       | ▲ 0.133     |           |           |           |           |           |           |
| 1M        |         |         |         |        |    |    | -       | ▲ 0.134     |           |           |           |           |           |           |
| 3M        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.145 | ▲ 0.133     |           |           |           |           |           |           |
| 6M        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.170 | ▲ 0.151     |           |           |           |           |           |           |
| 1Y        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.190 | ▲ 0.157     |           |           |           |           |           |           |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | 日付        | 6/5       | 6/6       | 6/7       | 6/10      | 6/11      |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | 日銀当預残     | 3,917,100 | 3,920,000 | 3,922,700 | 3,925,600 | 3,932,200 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | 準備預金残     | 3,427,300 | 3,448,800 | 3,442,200 | 3,444,400 | 3,441,500 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | マネタリーベース  | 5,033,200 | 5,036,200 | 5,038,500 | 5,040,600 | 5,046,800 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | 無担O/N加重平均 | ▲0.054%   | ▲0.053%   | ▲0.053%   | ▲0.056%   | ▲0.057%   |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | コール市場残高   | 99,868    | 98,990    | 105,844   | 100,177   | 104,002   |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | うち無担      | 79,638    | 78,889    | 84,510    | 80,363    | 83,933    |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | うちO/N     | 49,983    | 49,509    | 54,630    | 49,783    | 53,653    |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | うち有担      | 20,230    | 20,101    | 21,334    | 19,814    | 20,069    |

## ●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 | 応募総額(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) | 107,030        | 2019/6/12 | 2019/6/13 |      | 791           | 791           |                 | ▲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) |
|---------------|-------------------|-----------|------|------------|
| 被災地金融支援オペ     | 第98回<br>2019/6/14 | 2020/6/12 | 0    | 494        |
| 被災地金融支援オペ(熊本) | 第37回<br>2019/6/14 | 2020/6/12 | 0    | 369        |

## ●2019年6月13日の予定

|                     |                                 |
|---------------------|---------------------------------|
| *4-6月期の法人企業景気予測調査季報 | *30年利付国債入札<br>(7,000億円、6/14発行)  |
| *4月の第3次産業活動指数       | *交付税特別会計借入<br>(10,500億円、6/21借入) |

◆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