

# Central Daily Market Report

2019年6月13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13日 |        | 2019年6月14日 |         | 2019年6月17日      |           |
|-----------------------|------------|--------|------------|---------|-----------------|-----------|
|                       | 需給速報       |        | 需給予想       |         | 当社予想            |           |
| 銀行券                   | ▲ 800      |        | ▲ 400      |         |                 | 0         |
| 財政                    | 4,400      |        | 66,600     |         |                 | 10,000    |
| 資金過不足                 | 3,600      |        | 66,200     |         |                 | 10,000    |
| 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        | ▲ 700   |                 |           |
| 国債買現                  |            |        |            |         |                 |           |
| 国債売現                  |            |        |            |         |                 |           |
| 国庫短期証買入               |            |        |            |         |                 |           |
| 国債買入                  |            |        |            |         |                 |           |
| CP等買入                 |            | ▲ 100  | 2,500      | ▲ 200   |                 |           |
| 貸出支援基金(成)             |            |        |            |         |                 |           |
| 貸出支援基金(貸)             |            |        |            |         |                 |           |
| 被災地支援                 |            |        | 900        | ▲ 2,300 |                 |           |
| 社債等買入                 |            | ▲ 100  |            | ▲ 200   |                 |           |
| E T F 買入              | 100        |        | 800        |         |                 |           |
| 国債補完供給                | ▲ 400      | 800    |            | 400     |                 |           |
| 当預増減                  | 3,900      |        | 68,000     |         |                 | 10,000    |
| 当座預金残高                | 3,934,900  |        | 4,002,900  |         |                 | 4,012,900 |
| 準備預金残高                | 3,438,100  |        |            |         |                 |           |
| 積み終了先                 | 3,438,000  |        |            |         | 6月14日以降の残り所要積立額 |           |
| 超過準備                  | 3,438,000  |        |            |         | 積数              | 300       |
| 非準備預金先                | 496,800    |        |            |         | 1日平均            | 100       |
| 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         | 93.55%  |                 |           |

## ●2019年6月13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~▲0.040%の出会いとなった。明日を積み最終日に控えたことから若干調達サイドが増加し、▲0.065~▲0.040%のレンジで推移した。一巡後は▲0.086~▲0.055%で調整の出会いが見られた。ターム物に関しては特段目立った出会いが見られなかった。固定金利方式による共通担保資金供給オベは、2W物が15,000億円オファーされた。結果は593億円の応札であった。

### <レポ市場>

GCT/N(6/14-6/17)は、▲0.13~▲0.105%程度での出会い。新積み期にかかる取引となり、警戒感からオファーサイドは引いたところから入ったが、業者の売物も入り、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。30Y62回債はリオープン発行となったが、警戒感からターム物のビッドが多く入った。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は、低水準で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.148~▲0.145%、6M物が▲0.170~▲0.165%、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3,100億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と償還超であった。一部の鉄鋼・建設業態から大型の発行が見られたものの、案件数は少なく落ち着いたマーケットとなった。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

| 2019/6/13 | 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       | ▲ 0.086 | 0.001   | ▲ 0.057 |        |    |    | -       | ▲ 0.094 | ▲ 0.116   | ▲ 0.001   | 21,032.00 | ▲ 97.72   | 108.48-49 | 108.34-36 |
| T/N       |         |         |         |        |    |    | -       | ▲ 0.127 |           |           |           |           |           |           |
| S/N       |         |         |         |        |    |    | -       | -       |           |           |           |           |           |           |
| 1W        | ▲ 0.047 | ▲ 0.040 | ▲ 0.042 |        |    |    | -       | ▲ 0.130 |           |           |           |           |           |           |
| 2W        | ▲ 0.050 | ▲ 0.020 | ▲ 0.042 |        |    |    | -       | ▲ 0.132 |           |           |           |           |           |           |
| 3W        |         |         | 0.025   |        |    |    | -       | ▲ 0.136 |           |           |           |           |           |           |
| 1M        |         |         |         |        |    |    | -       | ▲ 0.134 |           |           |           |           |           |           |
| 3M        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.148 | ▲ 0.134 |           |           |           |           |           |           |
| 6M        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.170 | ▲ 0.151 |           |           |           |           |           |           |
| 1Y        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.188 | ▲ 0.157 |           |           |           |           |           |           |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | 日付        | 6/6       | 6/7       | 6/10      | 6/11      | 6/12      |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | 日銀当預残     | 3,920,000 | 3,922,700 | 3,925,600 | 3,932,200 | 3,931,000 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | 準備預金残     | 3,448,800 | 3,442,200 | 3,444,400 | 3,441,500 | 3,426,000 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | マネタリーベース  | 5,036,200 | 5,038,500 | 5,040,600 | 5,046,800 | 5,045,400 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | 無担O/N加重平均 | ▲0.053%   | ▲0.053%   | ▲0.056%   | ▲0.057%   | ▲0.058%   |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | コール市場残高   | 98,990    | 105,844   | 100,177   | 104,002   | 110,320   |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | うち無担      | 78,889    | 84,510    | 80,363    | 83,933    | 88,333    |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | うちO/N     | 49,509    | 54,630    | 49,783    | 53,653    | 56,553    |
|           |         |         |         |        |    |    |         |         | うち有担      | 20,101    | 21,334    | 19,814    | 20,069    | 21,987    |

## ●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) |
|---------|----|-------|--------|-----------|------------|-----------|-----------|----------|-------------|----------|----------|-------------|---------------|
| 30年利付国債 | 62 | 0.50% | 7,000  | 2019/6/14 | 2049/3/20  | 20,542.0  | 5,914.00  | 104.0500 | 0.3490%     | 73.8028% | 104.9200 | 0.3190%     | 1,083.0       |
| 交付税特会   | -  | -     | 10,500 | 2019/6/21 | 2019/12/20 | 284,419.0 | 10,500.17 |          | 0.0000%     | 3.6919%  |          | 0.0000%     |               |

## ●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         | 2019/6/14 | 2019/7/1  |      | 593           | 593           |                 |                 |                   |      |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 235,442        | 2019/6/13 | 2019/6/14 |      | 365           | 365           |                 | ▲0.350          | ▲0.350            |      |

## ●2019年6月14日の予定

\*池田日銀理事、第8回FinTech(フィンテック)フォーラムにおいて講演

\*米国4月の企業在庫  
\*米国5月の小売売上高  
\*米国5月の鉱工業生産・設備稼働率  
\*米国6月のミシガン大消費者信頼感指数速報

\*国庫短期証券(838回)入札(3ヶ月、43,300億円、6/17発行)

◆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