

Central Daily Market Report

2018年6月1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	2018年6月1日		2018年6月4日		2018年6月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		1,000		1,000	
財政	▲ 33,000		▲ 53,200		1,000	
資金過不足	▲ 33,400		▲ 52,200		2,000	
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			2,400	▲ 2,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			5,100			
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)			5,200	▲ 3,700		▲ 300
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 200		
E T F 買入			100			
国債補完供給	▲ 300	1,100		300		
当預増減	▲ 32,700		▲ 45,100		1,700	
当座預金残高	3,809,700		3,764,600		3,766,300	
準備預金残高	3,316,800					
積み終了先	3,316,600				6月4日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,316,400				積数	
非準備預金先	492,900				1日平均	
					200	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,124,900	
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	61.29%		

●2018年6月1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・証券業態を中心に▲0.086~▲0.045%の調達が見られた。引き続き調達を控えている先が多く、レートは低位横ばいとなった。一巡後は閑散で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで数件の出合いが見られた。共通担保資金供給オベは、8,000億円(6/4~6/18)オファーされ、応札額2,382億円(期落ち分1,983億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(6/1-6/4)は、▲0.100%近辺の出合い。T/N(6/4-6/5)は、▲0.140~▲0.110%程度での出合い。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。10Y336~350、5Y130~135などにビッドの出入りが目立った。

<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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.151~▲0.15%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1479%、按分落札利回▲0.1443%と前回債から小幅ながらレートが低下する結果となった。セカンダリーでは、▲0.148~▲0.1475%出合いと底堅く推移した。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は5・10日発行にあたり、償還総額700億円程度に対して、発行総額は1,200億円程度と発行超の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

2018/6/1	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	▲ 0.072				-	▲ 0.132	0.040	0.010	22,171.35	▲ 30.47	108.77-79	109.19-20
T/N			0.000				-	▲ 0.145						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.030	▲ 0.022				-	▲ 0.153						
2W	▲ 0.060	▲ 0.040	▲ 0.052				-	▲ 0.154						
3W							-	▲ 0.154						
1M							-	▲ 0.164						
3M							▲ 0.148	▲ 0.158						
6M							▲ 0.131	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.142	▲ 0.163						
									日付	5/25	5/28	5/29	5/30	5/31
									日銀当預残	3,827,300	3,838,500	3,841,800	3,836,100	3,842,400
									準備預金残	3,348,700	3,357,000	3,360,400	3,351,800	3,351,900
									マネタリーベース	4,911,200	4,922,400	4,925,900	4,920,100	4,926,700
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.069%	▲0.070%	▲0.070%	▲0.065%
									コール市場残高	86,160	83,040	77,024	78,816	68,231
									うち無担	68,024	58,424	61,135	62,356	56,000
									うちO/N	41,774	32,504	34,645	34,936	30,270
									うち有担	18,136	24,616	15,889	16,460	12,231

●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	761	-	43,500	2018/6/4	2018/9/3	157,539.0	35,345.60	100.0360	▲0.1443%	89.9119%	100.0369	▲0.1479%	8,154.0

●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>	8,000	2018/6/4	2018/6/18		2,382	2,382				
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/6/4			3,426	501	0.011		0.013	91.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2018/6/4			16,143	4,303	0.011		0.012	73.9
国債買入(物価連動債)	250	2018/6/4			1,234	250	▲0.180		▲0.195	45.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	75,317	2018/6/1	2018/6/4		272	272		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月4日の予定

*5月実績/6月見込み財政資金対民間収支 *米国4月の製造業新規受注・出荷・在庫
*5月のマネタリーベース

◆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