

Central Daily Market Report

2018年6月4日(月)

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4日		2018年6月5日		2018年6月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		500		1,000	
財政	▲ 55,000		2,700		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 54,100		3,200		▲ 19,000	
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			5,000			
国債買入	5,100		8,500			
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)	5,200	▲ 3,700				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200		▲ 100		
E T F買入	100		300			
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	▲ 47,200		16,800		▲ 19,000	
当座預金残高	3,762,500		3,779,300		3,760,300	
準備預金残高	3,290,700					
積み終了先	3,290,500					
超過準備	3,290,500				6月5日以降の残り所要積立額 積数 1,800	
非準備預金先	471,800				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	64.52%		

●2018年6月4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。本日は大幅な税揚げがあったものの、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。

<レポ市場>

GC T+0(6/4-6/5)は、▲0.120～▲0.110%程度の出合い。T/N(6/5-6/6)は、▲0.140～▲0.100%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、短国買入オペが5,000億円(前回と同額)でオファーされた。業者の在庫が膨らんでいるのか、応札額は2兆3,365億円台と多く、平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差+0.002%と小甘い結果となった。マーケットでは3M物が▲0.148～▲0.146%で出合った。

<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、案件数も少なく落ち着いたマーケットとなり、発行総額700億円程度に対して、償還総額800億円程度と償還超となった。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

2018/6/4	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	▲ 0.071				-	▲ 0.110	0.045	0.005	22,475.94	304.59	109.60-61	109.57-58
T/N			0.000				-	▲ 0.140						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.040	▲ 0.056				-	▲ 0.150						
2W	▲ 0.060	▲ 0.032	▲ 0.049				-	▲ 0.151						
3W							-	▲ 0.153						
1M			0.050				-	▲ 0.164						
3M							▲ 0.146	▲ 0.157						
6M							▲ 0.130	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.162						
									日付	5/28	5/29	5/30	5/31	6/1
									日銀当預残	3,838,500	3,841,800	3,836,100	3,842,400	3,809,700
									準備預金残	3,357,000	3,360,400	3,351,800	3,351,900	3,316,800
									マネタリーベース	4,922,400	4,925,900	4,920,100	4,926,700	4,894,500
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.070%	▲0.070%	▲0.065%	▲0.072%
									コール市場残高	83,040	77,024	78,816	68,231	79,794
									うち無担	58,424	61,135	62,356	56,000	64,083
									うちO/N	32,504	34,645	34,936	30,270	37,603
									うち有担	24,616	15,889	16,460	12,231	15,711

●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)	応募額(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
国庫短期証券買入	5,000	2018/6/5			23,365	5,001	0.002		0.003	60.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/6/5			12,733	2,502	0.006		0.007	51.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/6/5			11,749	3,304	0.006		0.006	93.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/6/5			6,533	1,913	0.007		0.008	15.2
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/6/5			2,240	706	0.008		0.009	55.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	87,710	2018/6/4	2018/6/5		160	160		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	19,578	2018/6/4	2018/6/5		5	5		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月5日の予定

*4月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比+0.8%)	*10年利付国債入札(22,000億円、6/6発行)
*6月の日銀当座預金増減要因見込み	
*5月のISM非製造業景況指数	

◆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お客様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