

Central Daily Market Report

2018年6月6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	2018年6月6日		2018年6月7日		2018年6月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		▲ 300			0
財政	▲ 17,900		6,000			▲ 6,000
資金過不足	▲ 17,300		5,700			▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,300			
CP等買入		▲ 300		▲ 100	2,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	400		100		
当預増減	▲ 17,500		16,000			▲ 3,500
当座預金残高	3,759,400		3,775,400			3,771,900
準備預金残高	3,298,400					
積み終了先	3,298,200				6月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,298,200				積数	1,400
非準備預金先	461,000				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	99.96%	日数	70.97%		

●2018年6月6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~▲0.05%の調達が見られた。調達を控えている先が増えてきており、オファーサイドの出し残りが目立つ地合いとなっている。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。ターム物も引き続き調達サイドが少なく、出合い難しい状況が続いている。

<レポ市場>

GC T+0(6/6-6/7)は、▲0.105~▲0.100%程度の出合い。T/N(6/7-6/8)は、▲0.125~▲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。10Y336~349、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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.14~▲0.136%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。発行市場は償還総額1,600億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と償還超であった。瓦斯業態において大型案件が見られたものの、案件数は膨らまず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

2018/6/6	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	▲ 0.072				-	▲ 0.103	0.045	0.000	22,625.73	86.19	109.88-89	110.06-08
T/N			0.000				-	▲ 0.113						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.030	▲ 0.051				-	▲ 0.130						
2W			0.000				-	▲ 0.133						
3W			0.030				-	▲ 0.135						
1M							-	▲ 0.153						
3M							▲ 0.137	▲ 0.151						
6M							▲ 0.130	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.161						
									日付	5/30	5/31	6/1	6/4	6/5
									日銀当預残	3,836,100	3,842,400	3,809,700	3,762,500	3,776,900
									準備預金残	3,351,800	3,351,900	3,316,800	3,290,700	3,312,600
									マネタリーベース	4,920,100	4,926,700	4,894,500	4,846,400	4,860,200
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.065%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.073%
									コール市場残高	78,816	68,231	79,794	77,236	80,923
									うち無担	62,356	56,000	64,083	60,070	61,876
									うちO/N	34,936	30,270	37,603	33,490	33,796
									うち有担	16,460	12,231	15,711	17,166	19,047

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2018/6/14	2018/12/13	220,964.0	10,500.16		0.0000%	4.7520%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/6/7			9,093	2,505	0.001		0.002	60.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/6/7			9,618	3,305	▲0.005		▲0.004	39.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2018/6/7			18,301	4,312	▲0.003		▲0.002	17.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	44,547	2018/6/6	2018/6/7		48	48		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月7日の予定

*4月の景気動向指数速報	*米国4月の消費者信用残高	*国庫短期証券(762回)入札(6ヶ月、23,000億円、6/11発行)
*5月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*ユーロ圏1-3月期のGDP確報値	*流動性供給入札(5,000億円、6/8発行)

◆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