Central Daily Market Report

2018年6月7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	2018年6月7日 需給速報		2018年6月8日 需給予想		2018年6月11日 当社予想	
銀行券	▲ 300		200		1,000	
財政	5,400		▲ 3,500		▲ 14,000	
資金過不足	5,100		▲ 3,300		▲ 13,000	
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						▲ 1,600
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		▲ 100	2,500	▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入			500			
国債補完供給		100				
当預増減	15,400		▲ 500		▲ 14,600	

当座預金残高	3,774,800	3,774,300	3,759,700
準備預金残高	3,317,000		
積み終了先	3,316,900		
超過準備	3,316,900		
非準備預金先	457,800		

6月8日以降の残り所要積立額	
積数	1,200
1日平均	200

積み期間（5/16～6/15）の所要準備額			3,123,100
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数 74.19%

●2018年6月7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。引き続き調達を控えている先が多く、オファーサイドの出し残りが目立った。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。ターム物も引き続き調達サイドが少なく、出合い難い状況が続いている。

<レポ市場>

GC T+0(6/7-6/8)は、▲0.105～▲0.100%程度の出合い。T/N(6/8-6/11)は、▲0.115～▲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、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.13%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1282%、按分落札利回▲0.1262%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは、▲0.136～▲0.1325%の出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場はその他金融業態でまとまった発行が見られたものの、発行総額は800億円程度にとどまり、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

2018/6/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.100	0.001	▲ 0.071				－	▲ 0.100
T/N			0.000				－	▲ 0.110
S/N							－	－
1W			▲ 0.055				－	▲ 0.125
2W							－	▲ 0.127
3W			▲ 0.010				－	▲ 0.134
1M							－	▲ 0.150
3M							▲ 0.130	▲ 0.148
6M							▲ 0.133	▲ 0.151
1Y							▲ 0.132	▲ 0.161

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.045	0.000	22,823.26	197.53	110.13-14	109.89-90

日付	5/31	6/1	6/4	6/5	6/6
日銀当預残	3,842,400	3,809,700	3,762,500	3,776,900	3,759,400
準備預金残	3,351,900	3,316,800	3,290,700	3,312,600	3,298,400
マネタリーベース	4,926,700	4,894,500	4,846,400	4,860,200	4,842,000
無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.073%	▲0.072%
コール市場残高	68,231	79,794	77,236	80,923	80,771
うち無担	56,000	64,083	60,070	61,876	57,120
うちO/N	30,270	37,603	33,490	33,796	29,020
うち有担	12,231	15,711	17,166	19,047	23,651

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	762	－	23,000	2018/6/11	2018/12/10	96,670.0	18,897.3	100.0630	▲0.1262%	30.4891%	100.0640	▲0.1282%	4,102.0
流動性供給	263	－	5,000	2018/6/8		15,603.0	4,990.00		0.0030%	40.6847%		0.0010%	

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	75,781	2018/6/7	2018/6/8		14	14		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月8日の予定

*1-3月期のGDP2次速報
（市場予想：前期比年率▲0.4%）
*4月の国際収支
*5月の景気ウォッチャー調査
*米国4月の卸売売上高
*国庫短期証券（763回）入札
（3ヶ月、44,000億円、6/11発行）
*エネルギー対策借入
（7,500億円、6/20借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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