

Central Daily Market Report

2018年6月8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8日		2018年6月11日		2018年6月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		900		1,000	
財政	▲ 4,000		▲ 16,000		3,000	
資金過不足	▲ 3,700		▲ 15,100		4,000	
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			1,500	▲ 1,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			3,900			
CP等買入	2,500	▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入	500		200			
国債補完供給	▲ 400			400		
当預増減	▲ 1,300		▲ 11,200		4,000	
当座預金残高	3,773,500		3,762,300		3,766,300	
準備預金残高	3,310,000					
積み終了先	3,309,900				6月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,309,800				積数	
非準備預金先	463,500				1日平均	
					700	
					100	
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	99.98%	日数	83.87%		

●2018年6月8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。週末を挟む取引となったものの、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。共通担保資金供給オペは、8,000億円(6/11~6/25)オファーされ、応札額1,520億円(期落ち分1,571億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(6/8-6/11)は、▲0.10~▲0.085%程度の出合い。T/N(6/11-6/12)は、▲0.10~▲0.085%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は小幅上昇した。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▲0.134~▲0.13%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1295%、按分落札利回▲0.1243%とマーケットの慎重姿勢を反映する結果となった。セカンダリーでは、▲0.13~▲0.125%の出合いと、按分レート近辺で推移した。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は卸売業態で大型発行が見られたものの案件は少なく、発行総額は900億円弱の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

2018/6/8	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				-	▲ 0.095	0.040	▲ 0.005	22,694.50	▲ 128.76	109.71-73	109.41-42
T/N			0.000				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.003	▲ 0.060				-	▲ 0.117						
2W	▲ 0.055	0.020	▲ 0.018				-	▲ 0.123						
3W							-	▲ 0.147						
1M							-	▲ 0.147						
3M							▲ 0.127	▲ 0.146						
6M							▲ 0.133	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.161						
									日付	6/1	6/4	6/5	6/6	6/7
									日銀当預残	3,809,700	3,762,500	3,776,900	3,759,400	3,774,800
									準備預金残	3,316,800	3,290,700	3,312,600	3,298,400	3,317,100
									マネタリーベース	4,894,500	4,846,400	4,860,200	4,842,000	4,857,700
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.071%	▲0.073%	▲0.072%	▲0.071%
									コール市場残高	79,794	77,236	80,923	80,771	89,105
									うち無担	64,083	60,070	61,876	57,120	60,635
									うちO/N	37,603	33,490	33,796	29,020	32,045
									うち有担	15,711	17,166	19,047	23,651	28,470

●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	763	-	43,500	2018/6/11	2018/9/10	170,793.0	35,336.3	100.0310	▲0.1243%	5.1715%	100.0323	▲0.1295%	8,163.0
エネルギー対策	-	-	7,500	2018/6/20	2019/6/20	121,004.0	7,499.84		0.0000%	6.2599%		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>	8,000	2018/6/11	2018/6/25		1,520	1,520				
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/6/11			5,720	1,904	▲0.002		0.001	57.5
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/6/11			2,990	704	0.002		0.003	18.1
国債買入(変動利付債)	1,000	2018/6/11			2,221	1,004	▲0.110		▲0.141	46.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	132,835	2018/6/8	2018/6/11		402	402		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	40,563	2018/6/8	2018/6/11		1	1		▲0.600	▲0.600	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
被災地金融支援オペ	第86回	2018/6/14	2019/6/14	0	494					
被災地金融支援オペ(熊本)	第25回	2018/6/14	2019/6/14	0	1,763					

●2018年6月11日の予定

*4月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+2.8%)
*4月の特定サービス産業動態統計速報

*5月のマネーストック

◆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