

Central Daily Market Report

2018年6月11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11日 需給速報	2018年6月12日 需給予想	2018年6月13日 当社予想
銀行券	800	▲ 100	0
財政	▲ 17,200	2,900	▲ 5,000
資金過不足	▲ 16,400	2,800	▲ 5,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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			12,500
国債買入	3,900		
CP等買入		▲ 400	▲ 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		▲ 100	▲ 300
E T F買入	200		1,700
国債補完供給	▲ 700	400	700
当預増減	▲ 13,200	17,200	▲ 5,000
当座預金残高	3,760,300	3,777,500	3,772,500
準備預金残高	3,316,200		
積み終了先	3,316,000		6月12日以降の残り所要積立額
超過準備	3,316,000		積数
非準備預金先	444,100		1日平均
			500
			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
			87.10%

●2018年6月11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。積み最終週となったものの、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で推移した。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(6/11-6/12)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。T/N(6/12-6/13)は、▲0.085~▲0.08%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T/Nは、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペが12,500億円(前日比+7,500億円)で実施された。応札額が4兆2,286億円まで膨らむ中、平均落札利回較差▲0.003%、按分落札利回較差▲0.005%と強めの結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.132~▲0.127%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は小売業態でまとまった量の発行が見られたものの案件数は膨らまず、償還総額200億円弱に対し発行総額は700億円程度となった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/6/11	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				-	▲ 0.090	0.040	0.000	22,804.04	109.54	109.47-48	109.96-97
T/N			0.000				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	0.000	▲ 0.043				-	▲ 0.110						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.115						
3W			0.030				-	▲ 0.145						
1M							-	▲ 0.144						
3M			0.070				▲ 0.131	▲ 0.145						
6M							▲ 0.135	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.161						
									日付	6/4	6/5	6/6	6/7	6/8
									日銀当預残	3,762,500	3,776,900	3,759,400	3,774,800	3,773,500
									準備預金残	3,290,700	3,312,600	3,298,400	3,317,100	3,310,000
									マネタリーベース	4,846,400	4,860,200	4,842,000	4,857,700	4,856,100
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.073%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.072%
									コール市場残高	77,236	80,923	80,771	89,105	91,927
									うち無担	60,070	61,876	57,120	60,635	62,238
									うちO/N	33,490	33,796	29,020	32,045	32,958
									うち有担	17,166	19,047	23,651	28,470	29,689

●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	12,500	2018/6/12			42,286	12,503	▲0.005		▲0.003	32.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	139,845	2018/6/11	2018/6/12		681	681		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	39,950	2018/6/11	2018/6/12		24	24		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月12日の予定

*4月の第3次産業活動指数	*米国FOMC(1日目)	*流動性供給入札(6,000億円、6/13発行)
*5月の企業物価指数	*米国5月の財政収支	
	*米国5月の消費者物価指数	

◆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