

Central Daily Market Report

2018年6月12日(火)

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12日		2018年6月13日		2018年6月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		400		▲ 1,000	
財政	2,400		▲ 9,300		2,000	
資金過不足	2,300		▲ 8,900		1,000	
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	12,500					
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					2,300	▲ 900
社債等買入		▲ 300				
E T F 買入	1,700		500			
国債補完供給	▲ 300	700		300		
当預増減	16,400		▲ 8,200		2,400	
当座預金残高	3,776,700		3,768,500		3,770,900	
準備預金残高	3,351,000					
積み終了先	3,350,900				6月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,350,900				積数	400
非準備預金先	425,700				1日平均	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	99.99%	日数	90.32%		

●2018年6月12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。積み最終に近づき、やや取りの調整が見られたことでオファーサイドの出し残りが減ったものの、レートは概ね低位横ばいの推移となった。一巡後は閑散で散発的な出会いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は新積み期スタートの気配が見えたが目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(6/12-6/13)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。T/N(6/13-6/14)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、国内外の重要イベントを控えて閑散な中、3M物が▲0.133%で出合った程度だった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、不動産やノンバンク業態でまとまった額の調達が行われたが、発行総額は1,100億円程度と償還総額と同程度にとどまった。発行レートは一部銘柄を除き、0%近辺で推移した。本日はCP等買入オベが、2,500億円オファーされた。結果は平均落札レート▲0.002%、按分落札レート▲0.007%と、前回比(平均▲0.003%、按分▲0.005%)で平均は上昇、按分は低下した。

●短期金融市場関連指標

2018/6/12	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				-	▲ 0.085	0.045	0.005	22,878.35	74.31	110.38-39	110.31-33
T/N			0.000				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.055	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.112						
3W			0.030				-	▲ 0.138						
1M			▲ 0.075				-	▲ 0.140						
3M							▲ 0.133	▲ 0.144						
6M							▲ 0.135	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.161						
									日付	6/5	6/6	6/7	6/8	6/11
									日銀当預残	3,776,900	3,759,400	3,774,800	3,773,500	3,760,300
									準備預金残	3,312,600	3,298,400	3,317,100	3,310,000	3,316,200
									マネタリーベース	4,860,200	4,842,000	4,857,700	4,856,100	4,842,200
									無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.072%	▲0.071%
									コール市場残高	80,923	80,771	89,105	91,927	94,371
									うち無担	61,876	57,120	60,635	62,238	65,250
									うちO/N	33,796	29,020	32,045	32,958	36,100
									うち有担	19,047	23,651	28,470	29,689	29,121

●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)
流動性供給	264	-	6,000	2018/6/13		18,124.0	5,978.00		▲0.0020%	94.5027%		▲0.0030%	

●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	応募総額(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
CP等買入	2,500	2018/6/15			6,233	2,485	▲0.007		▲0.002	27.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	49,585	2018/6/12	2018/6/13		135	135		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,000	2018/6/12	2018/6/13		210	210		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/6/14	2018/6/21	2.38	0	0				

●2018年6月13日の予定

*米国FOMC(2日目)
*米国FRB経済見通し発表
*米国5月の生産者物価指数

*英国5月の消費者物価指数

*交付税特別会計借入
(10,500億円、6/21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