

Central Daily Market Report

2018年6月13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13日		2018年6月14日		2018年6月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 1,000		▲ 1,000	
財政	▲ 7,100		2,600		84,000	
資金過不足	▲ 6,700		1,600		83,000	
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			5,200			
CP等買入		▲ 100	▲ 100		2,500	
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				▲ 100		
E T F 買入	500		900			
国債補完供給	▲ 500	300		500		
当預増減	▲ 6,500		9,400		85,500	
当座預金残高	3,770,200		3,779,600		3,865,100	
準備預金残高	3,344,000					
積み終了先	3,343,900					6月14日以降の残り所要積立額
超過準備	3,343,900					積数
非準備預金先	426,200					1日平均
						200
						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	93.55%		

●2018年6月13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、取りの調整が見られたことで、一部では取り上がる動きも見られた。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。ターム物は新積み期スタートで▲0.05%台で引き合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T+0(6/13-6/14)は、▲0.075～▲0.07%程度の出合い。T/N(6/14-6/15)は、▲0.085～▲0.075%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。アウトライト市場は動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。発行市場は五・十日発行に当たり、ゴム、機械、石油等複数業態で500億円超の大ロットでの発行がみられ、発行総額は3,600億円程度まで膨らんだものの、償還総額4,200億円程度を下回った。発行レートは、期内物においても特段の上昇圧力は観測されず、全体的に低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/6/13	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.082	0.045	0.000	22,966.38	88.03	110.44-46	110.63-64	
T/N			0.000				-	▲ 0.087							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.062	▲ 0.020	▲ 0.053				-	▲ 0.105							
2W	▲ 0.055	▲ 0.010	▲ 0.047				-	▲ 0.115							
3W			0.030				-	▲ 0.139							
1M							-	▲ 0.141							
3M							▲ 0.133	▲ 0.144							
6M							▲ 0.135	▲ 0.151							
1Y							▲ 0.131	▲ 0.161							
									日付		6/6	6/7	6/8	6/11	6/12
									日銀当預残	3,759,400	3,774,800	3,773,500	3,760,300	3,776,700	
									準備預金残	3,298,400	3,317,100	3,310,000	3,316,200	3,351,100	
									マナタリーベース	4,842,000	4,857,700	4,856,100	4,842,200	4,858,700	
									無担O/N加重平均	▲ 0.072%	▲ 0.071%	▲ 0.072%	▲ 0.071%	▲ 0.071%	
									コール市場残高	80,771	89,105	91,927	94,371	96,406	
									うち無担	57,120	60,635	62,238	65,250	66,320	
									うちO/N	29,020	32,045	32,958	36,100	37,470	
									うち有担	23,651	28,470	29,689	29,121	30,086	

●入札結果

名称	回数	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	2018/6/21	2018/12/21	222,861.0	10,500.14		0.0000%	4.7370%		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年以下)	500	2018/6/14			4,172	500	0.014		0.016	30.6
国債買入(残存期間5年起10年以下)	4,300	2018/6/14			13,653	4,309	0.001		0.002	46.4
国債買入(物価連動債)	250	2018/6/14			1,202	251	0.010		▲ 0.006	45.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	41,806	2018/6/13	2018/6/14		442	442		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年6月14日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、15日まで)	*ECB定例理事会(金融政策発表) *米国4月の企業在庫 *米国5月の小売売上高	*国庫短期証券(764回)入札(3ヶ月、44,000億円、6/18発行)
------------------------------	--	--------------------------------------

◆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