

Central Daily Market Report

2018年6月14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14日		2018年6月15日		2018年6月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 800		0	
財政	1,200		82,900		▲ 1,000	
資金過不足	100		82,100		▲ 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						▲ 2,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,200		8,600			
CP等買入		▲ 100	2,500	▲ 1,000		
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				
ETF買入	900					
国債補完供給	▲ 200	500		200		
当預増減	7,700		92,400		▲ 3,400	
当座預金残高	3,777,900		3,870,300		3,866,900	
準備預金残高	3,368,600					
積み終了先	3,368,500				6月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,368,500				積数	
非準備預金先	409,300				1日平均	
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	100.00%	日数	96.77%		

●2018年6月14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~▲0.04%の調達が見られた。積み最終の取りの調整が見られたことで一部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▲0.06%台で引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(6/14-6/15)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。T/N(6/15-6/18)は、▲0.110~▲0.090%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、小幅低下した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引においては、▲0.127%の出合いが見られた。入札結果は平均落札利回▲0.1257%、按分落札利回▲0.1209%とマーケットの慎重姿勢を反映した結果となった。入札後は、▲0.124~▲0.123%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、ノンバンク業態1社で1,000億円弱の大型案件が実施され、発行総額は1,700億円程度と償還総額の1,200億円弱を上回った。発行レートは、一部発行量の少ない物で低めの出合いが見られたが、概ね0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/6/14	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.067				-	▲ 0.084	0.035	▲ 0.010	22,738.61	▲ 227.77	110.23-24	109.92-93
T/N			0.000				-	▲ 0.109						
S/N			0.001				-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.040	▲ 0.053				-	▲ 0.120						
2W	▲ 0.060	▲ 0.010	▲ 0.040				-	▲ 0.123						
3W			0.030				-	▲ 0.147						
1M							-	▲ 0.145						
3M							▲ 0.125	▲ 0.145						
6M							▲ 0.134	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.161						
									日付	6/7	6/8	6/11	6/12	6/13
									日銀当預残	3,774,800	3,773,500	3,760,300	3,776,700	3,770,200
									準備預金残	3,317,100	3,310,000	3,316,200	3,351,100	3,344,000
									マネタリーベース	4,857,700	4,856,100	4,842,200	4,858,700	4,851,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.071%	▲ 0.072%	▲ 0.071%	▲ 0.071%	▲ 0.068%
									コール市場残高	89,105	91,927	94,371	96,406	97,447
									うち無担	60,635	62,238	65,250	66,320	68,986
									うちO/N	32,045	32,958	36,100	37,470	40,766
									うち有担	28,470	29,689	29,121	30,086	28,461

●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	764	-	43,600	2018/6/18	2018/9/18	145,340.0	35,529.10	100.0305	▲0.1209%	1.3904%	100.0317	▲0.1257%	8,070.0

●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年超3年以下)	2,500	2018/6/15			9,342	2,508	0.002		0.003	42.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/6/15			10,375	3,005	▲0.004		▲0.003	21.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/6/15			5,983	1,910	▲0.004		▲0.003	34.4
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/6/15			2,328	704	0.002		0.003	66.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	73,112	2018/6/14	2018/6/15		180	180		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月15日の予定

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *黒田日銀総裁定例会見
- *4月の石油等消費動態統計
- *米国5月の鉱工業生産・設備稼働率
- *米国6月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *ユーロ圏5月の消費者物価指数改定値

◆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