

# Central Daily Market Report

2018年6月15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15日		2018年6月18日		2018年6月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		200		0	
財政	82,700		2,000		1,000	
資金過不足	81,900		2,200		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	▲ 2,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	8,600					
CP等買入	2,500	▲ 1,000		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給		200				
当預増減	92,200		1,700		1,000	
当座預金残高	3,870,100		3,871,800		3,872,800	
準備預金残高	3,409,500					
積み終了先	3,409,500				6月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,409,400				積数	103,400
非準備預金先	460,600				1日平均	3,700
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,017,200
準備預金進捗率	実績	96.57%	日数	6.67%		

## ●2018年6月15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▲0.08~▲0.04%の調達が見られた。積み最終日での調整が見られたことで取り上がる動きが見られた。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。ターム物は調達サイドが少なく、目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オペは、8,000億円(6/18~7/2)オファーされ、応札額2,382億円(期落ち分2,382億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T+0(6/15-6/18)は、出合い閑散。T/N(6/18-6/19)は、▲0.110~▲0.095%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、閑散な中、3M物が▲0.123~▲0.122%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。発行市場は案件膨らまず、償還総額1,300億円程度に対し発行総額は600億円程度と償還超となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移したが、発行頻度の低い銘柄で低いレートでの出合いが見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2018/6/15	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.106	0.030	▲ 0.005	22,851.75	113.14	110.63-65	110.51-52
T/N			0.000				-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.057	▲ 0.050	▲ 0.054				-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.055	0.050	▲ 0.029				-	▲ 0.150						
3W			0.030				-	▲ 0.145						
1M							-	▲ 0.147						
3M							▲ 0.123	▲ 0.144						
6M							▲ 0.133	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.161						
									日付	6/8	6/11	6/12	6/13	6/14
									日銀当預残	3,773,500	3,760,300	3,776,700	3,770,200	3,777,900
									準備預金残	3,310,000	3,316,200	3,351,100	3,344,000	3,368,600
									マネタリーベース	4,856,100	4,842,200	4,858,700	4,851,800	4,860,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.072%	▲ 0.071%	▲ 0.071%	▲ 0.068%	▲ 0.067%
									コール市場残高	91,927	94,371	96,406	97,447	116,308
									うち無担	62,238	65,250	66,320	68,986	84,640
									うちO/N	32,958	36,100	37,470	40,766	51,140
									うち有担	29,689	29,121	30,086	28,461	31,668

## ●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2018/6/18	2018/7/2		2,382	2,382				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	80,962	2018/6/15	2018/6/18		6	6		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/6/15	2018/6/18		1	1		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年6月18日の予定

*5月の貿易統計
----------

## ●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。 (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1) 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとして、金利操作方針を実現するよう運営する。 (2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて) ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。 ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------