Central Daily Market Report

2018年6月18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18日 需給速報		2018年6月19日 需給予想		2018年6月20日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 300		▲ 1,000	
財政	1,300		900		60,000	
資金過不足	1,200		600		59,000	
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			7,500			
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 200		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）					17,600	▲ 49,400
被災地支援						
社債等買入				▲ 300		
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	600		7,700		27,200	

当座預金残高	3,870,700	3,878,400	3,905,600
準備預金残高	3,400,800		
積み終了先	3,365,200		
超過準備	3,351,700		
非準備預金先	469,900		

6月19日以降の残り所要積立額	
積数	54,300
1日平均	2,000

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	98.20%	日数 10.00%

●2018年6月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は邦銀・証券業態を中心に▲0.086～▲0.04%での調達で始まった。積み初日の取引ということもあり、調達ニーズは限定的であった。また、近畿地方の地震の影響で調達を控える先も一部で見られた。一巡後は▲0.086%での出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては月内エンド物で▲0.06%近辺での出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(6/18-6/19)は、▲0.100～▲0.090%程度の出合い。T/N(6/19-6/20)は、▲0.115～▲0.105%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7,500億円(前回比▲5,000億円)で実施された。応札額が25,842億円と多く、平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.002%と堅調な結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.129～▲0.128%、6M物が▲0.136%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20日発行の応当日であったことや、鉄鋼業態を中心に大型案件が散見されたことから、発行額は3,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは引き続き0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/6/18	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.069				－	▲ 0.097
T/N			0.000				－	▲ 0.112
S/N							－	－
1W	▲ 0.075	0.230	▲ 0.046				－	▲ 0.124
2W							－	▲ 0.150
3W			▲ 0.070				－	▲ 0.145
1M							－	▲ 0.146
3M							▲ 0.127	▲ 0.144
6M							▲ 0.133	▲ 0.151
1Y							▲ 0.130	▲ 0.161

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.030	0.000	22,680.33	▲ 171.42	110.63-64	110.47-48

日付	6/11	6/12	6/13	6/14	6/15
日銀当預残	3,760,300	3,776,700	3,770,200	3,777,900	3,870,100
準備預金残	3,316,200	3,351,100	3,344,000	3,368,600	3,409,500
マネタリーベース	4,842,200	4,858,700	4,851,800	4,860,500	4,953,500
無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.071%	▲0.068%	▲0.067%	▲0.064%
コール市場残高	94,371	96,406	97,447	116,308	109,536
うち無担	65,250	66,320	68,986	84,640	85,086
うちO/N	36,100	37,470	40,766	51,140	52,746
うち有担	29,121	30,086	28,461	31,668	24,450

●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Ｉ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	7,500	2018/6/19			25,842	7,502	▲0.002		▲0.001	16.5
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	56,049	2018/6/18	2018/6/19		62	62		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	9,950	2018/6/18	2018/6/19		0	0				

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
貸出増加支援オペ	貸付期間4年（新規貸付）	2018/6/20	2022/6/20	0	17,559

●2018年6月19日の予定

*月例経済報告	米国5月の住宅着工件数	*国庫短期証券（765回）入札 （1年、21,000億円、6/20発行） *30年利付国債入札 （7,000億円、6/20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。
◆本資料は何ら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論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