Central Daily Market Report

2018年6月19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19日 需給速報		2018年6月20日 需給予想		2018年6月21日 当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 900		▲ 1,000	
財政	1,500		59,100		▲ 6,000	
資金過不足	1,000		58,200		▲ 7,000	
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	7,500					
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 600		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）			17,600	▲ 19,700		
被災地支援						
社債等買入		▲ 300		▲ 1,100		
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 800	100		800		
当預増減	7,300		55,200		▲ 7,000	

当座預金残高	3,878,000	3,933,200	3,926,200
準備預金残高	3,416,200		
積み終了先	3,400,900		
超過準備	3,395,600		
非準備預金先	461,800		

6月20日以降の残り所要積立額	
積数	33,700
1日平均	1,300

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	98.88%	日数 13.33%

●2018年6月19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～▲0.05%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは弱く、一巡後は目立った出合いは見られず、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%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(6/19-6/20)は、▲0.100～▲0.090%程度の出合い。T/N(6/20-6/21)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、横ばいで推移した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引においては、▲0.13%の出合いが少額見られた。入札結果は平均落札利回▲0.1298%、按分落札利回▲0.1268%と無難な結果となった。入札後は▲0.135～▲0.132%での出合いが見られるなど堅調に推移した。マーケットでは、3M物が▲0.132～▲0.129%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は電力、ノンバンク業態から大型案件が見られ、発行額は1,800億円程度であった（償還額700億円程度）。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/6/19	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	▲ 0.070				－	▲ 0.099
T/N			0.000				－	▲ 0.111
S/N							－	－
1W			▲ 0.040				－	▲ 0.126
2W			0.080				－	▲ 0.152
3W							－	▲ 0.146
1M							－	▲ 0.145
3M							▲ 0.129	▲ 0.143
6M							▲ 0.134	▲ 0.150
1Y							▲ 0.134	▲ 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）
0.025	▲ 0.005	22,278.48	▲ 401.85	110.14-15	109.74-76

日付	6/12	6/13	6/14	6/15	6/18
日銀当預残	3,776,700	3,770,200	3,777,900	3,870,100	3,870,700
準備預金残	3,351,100	3,344,000	3,368,600	3,409,500	3,401,800
マネタリーベース	4,858,700	4,851,800	4,860,500	4,953,500	4,954,200
無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.068%	▲0.067%	▲0.064%	▲0.069%
コール市場残高	96,406	97,447	116,308	109,536	86,478
うち無担	66,320	68,986	84,640	85,086	63,464
うちO/N	37,470	40,766	51,140	52,746	34,964
うち有担	30,086	28,461	31,668	24,450	23,014

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	765	－	21,000	2018/6/20	2019/6/20	84,677.0	17,066.9	100.1270	▲0.1268%	49.5000%	100.1300	▲0.1298%	3,933.0
30年利付国債	58	0.80%	7,000	2018/6/20	2048/3/20	23,989.0	5,685.00	102.2000	0.7100%	39.1509%	102.2700	0.7070%	1,304.0

●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
社債等買入	1,750	2018/6/25			4,007	1,750	▲0.194		▲0.120	50.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	96,120	2018/6/19	2018/6/20		774	774		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	19,895	2018/6/19	2018/6/20		12	12		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/6/21	2018/6/28	2.41	0	0				

●2018年6月20日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨（4月26、27日開催分）
*米国5月の中古住宅販売

◆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