

Central Daily Market Report

2018年6月20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20日		2018年6月21日		2018年6月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,700		▲ 2,000	
財政	58,000		▲ 3,900		▲ 21,000	
資金過不足	57,100		▲ 5,600		▲ 23,000	
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			7,300			
CP等買入		▲ 600		▲ 100		
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		▲ 1,100				
E T F買入			100			
国債補完供給	▲ 600	800		600		
当預増減	53,500		2,300		▲ 23,000	
当座預金残高	3,931,500		3,933,800		3,910,800	
準備預金残高	3,449,200					
積み終了先	3,442,800				6月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,435,200				積数	19,700
非準備預金先	482,300				1日平均	800
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	99.35%	日数	16.67%		

●2018年6月20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。昨日と同様調達ニーズは弱く、一巡後は調整程度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▲0.07%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(6/20-6/21)は、▲0.100~▲0.090%程度の出合い。T/N(6/21-6/22)は、▲0.135~▲0.105%程度での出合い。T/Nは運用サイドが先行しレート低下となった。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。10Y336~350、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、売り物が少なく閑散な中、3M物が▲0.15~▲0.146%での出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、鉄鋼業態から大型案件が見られたものの、案件少なく1,200億円程度の発行であった(償還額1,700億円程度)。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

2018/6/20	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)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.073				-	▲ 0.104	0.030	0.005	22,555.43	276.95	110.08-10	110.21-23
T/N			0.000				-	▲ 0.122						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.080	▲ 0.020	▲ 0.070				-	▲ 0.131						
2W	0.010	0.085	0.038				-	▲ 0.159						
3W							-	▲ 0.149						
1M							-	▲ 0.148						
3M							▲ 0.140	▲ 0.144						
6M							▲ 0.134	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.134	▲ 0.160						
									日付	6/13	6/14	6/15	6/18	6/19
									日銀当預残	3,770,200	3,777,900	3,870,100	3,870,700	3,878,000
									準備預金残	3,344,000	3,368,600	3,409,500	3,401,800	3,416,200
									マネタリーベース	4,851,800	4,860,500	4,953,500	4,954,200	4,961,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.068%	▲ 0.067%	▲ 0.064%	▲ 0.069%	▲ 0.070%
									コール市場残高	97,447	116,308	109,536	86,478	86,511
									うち無担	68,986	84,640	85,086	63,464	65,695
									うちO/N	40,766	51,140	52,746	34,964	37,265
									うち有担	28,461	31,668	24,450	23,014	20,816

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2018/6/21			14,057	4,307	0.007		0.007	79.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/6/21			5,937	1,916	0.006		0.007	24.4
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/6/21			2,452	705	0.003		0.004	75.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	1,000	2018/6/20	2018/6/21		610	610		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年6月21日の予定

*布野日銀審議委員、宮城県金融経済懇談会にて講演	*英中銀MPC結果発表	*5年利付国債入札(20,000億円、6/22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