

Central Daily Market Report

2018年6月21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21日		2018年6月22日		2018年6月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 1,400			0
財政	▲ 4,300		▲ 17,900			▲ 2,000
資金過不足	▲ 6,100		▲ 19,300			▲ 2,000
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						▲ 1,500
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		▲ 100		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						1,800
E T F買入	100					
国債補完供給	▲ 500	600		500		
当預増減	1,300		▲ 19,200			▲ 1,700
当座預金残高	3,932,800		3,913,600			3,911,900
準備預金残高	3,452,000					
積み終了先	3,447,000				6月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,446,900				積数	14,600
非準備預金先	480,800				1日平均	600
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	99.52%	日数	20.00%		

●2018年6月21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%での調達が始まった。引き続き調達ニーズは弱く、一巡後は目立った出合いが見られず、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▲0.08%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(6/21-6/22)は、▲0.115~▲0.105%程度の出合い。T/N(6/22-6/25)は、▲0.120%~▲0.115%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。10Y336~350、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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、動意なく閑散で特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、25日発行の応当日であったが大型案件少なく、発行は2,000億円程度と償還超であった。(償還額3,300億円程度)。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

2018/6/21	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.102	0.030	0.000	22,693.04	137.61	110.37-38	110.53-54		
T/N			0.000				-	▲ 0.122								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.080	▲ 0.040	▲ 0.060				-	▲ 0.132								
2W							-	▲ 0.164								
3W							-	▲ 0.152								
1M							-	▲ 0.149								
3M							▲ 0.141	▲ 0.144								
6M							▲ 0.134	▲ 0.150								
1Y							▲ 0.134	▲ 0.160								
											日付	6/14	6/15	6/18	6/19	6/20
											日銀当預残	3,777,900	3,870,100	3,870,700	3,878,000	3,931,500
											準備預金残	3,368,600	3,409,500	3,401,800	3,416,200	3,449,200
											マネタリーベース	4,860,500	4,953,500	4,954,200	4,961,900	5,016,300
											無担O/N加重平均	▲ 0.067%	▲ 0.064%	▲ 0.069%	▲ 0.070%	▲ 0.073%
											コール市場残高	116,308	109,536	86,478	86,511	92,732
											うち無担	84,640	85,086	63,464	65,695	65,647
											うちO/N	51,140	52,746	34,964	37,265	36,057
											うち有担	31,668	24,450	23,014	20,816	27,085

●入札結果

名称	回数	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)
5年利付国債	135	0.10%	20,000	2018/6/22	2023/3/20	64,315.0	16,587.00	101.0000	▲0.1090%	61.1594%	101.0200	▲0.1130%	3,404.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	86,542	2018/6/21	2018/6/22		196	196		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	22,324	2018/6/21	2018/6/22		300	300		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月22日の予定

*5月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.7%
*国庫短期証券(766回)入札 (3ヶ月、44,000億円、6/25発行)

◆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