

Central Daily Market Report

2018年6月22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22日	2018年6月25日	2018年6月26日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 1,500	▲ 100	▲ 1,000
財政	▲ 17,400	6,000	1,000
資金過不足	▲ 18,900	5,900	0
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		1,300	▲ 1,500
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		9,900	
CP等買入		▲ 400	▲ 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		1,800	▲ 200
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 900	500	900
当預増減	▲ 19,700	17,600	0
当座預金残高	3,913,100	3,930,700	3,930,700
準備預金残高	3,434,500		
積み終了先	3,433,800	6月25日以降の残リ所要積立額	
超過準備	3,431,100	積数	4,500
非準備預金先	478,600	1日平均	200
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	99.85%	日数
			30.00%

●短期金融市場関連指標

2018/6/22	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	売買参考統計値	平均値	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	▲ 0.075				-	▲ 0.109	0.025	▲ 0.005	22,516.83	▲ 176.21	109.95-97	110.15-16
T/N			0.000				-	▲ 0.120						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.080	0.000	▲ 0.043				-	▲ 0.180						
2W							-	▲ 0.157						
3W	▲ 0.065	0.050	▲ 0.050				-	▲ 0.148						
1M							-	▲ 0.145						
3M							▲ 0.134	▲ 0.143						
6M							▲ 0.132	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.160						

日付		6/15	6/18	6/19	6/20	6/21
日銀当預残		3,870,100	3,870,700	3,878,000	3,931,500	3,932,800
準備預金残		3,409,500	3,401,800	3,416,200	3,449,200	3,452,000
マネタリーベース		4,953,500	4,954,200	4,961,900	5,016,300	5,019,400
無担O/N加重平均		▲ 0.064%	▲ 0.069%	▲ 0.070%	▲ 0.073%	▲ 0.072%
コール市場残高		109,536	86,478	86,511	92,732	87,709
うち	無担	85,086	63,464	65,695	65,647	67,546
	うちO/N	52,746	34,964	37,265	36,057	36,016
	うち有担	24,450	23,014	20,816	27,085	20,163

●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1非価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	766	-	43,700	2018/6/25	2018/9/25	146,477.0	35,392.50	100.0325	▲0.1288%	78.8621%	100.0334	▲0.1324%	8,307.0

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2018/6/25	2018/7/9		1,260	1,260				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/6/25			12,968	2,505	0.005		0.005	73.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/6/25			10,248	3,009	0.001		0.001	80.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2018/6/25			14,135	4,311	▲0.001		0.000	61.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	50,726	2018/6/22	2018/6/25		566	566		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,319	2018/6/22	2018/6/25		322	322		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月25日の予定

*決定会合における主な意見(6月14、15日分)	*米国5月の新築一戸建て販売件数
*4月の景気動向指数改訂状況	

◆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