

# Central Daily Market Report

2018年6月25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25日 需給速報	2018年6月26日 需給予想	2018年6月27日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	3,900	200	▲ 11,000
資金過不足	3,600	▲ 800	▲ 12,000
<b>金融調節</b>			
	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			7,500
国債買入	9,900		
CP等買入		▲ 500	▲ 200
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	▲ 400	900	400
当預増減	14,900	6,900	▲ 12,000
当座預金残高	3,928,000	3,934,900	3,922,900
準備預金残高	3,441,100		
積み終了先	3,440,700		
超過準備	3,440,700		
非準備預金先	486,900		
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	99.86%	日数
			33.33%

## ●2018年6月25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▲0.08%近辺の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目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T+0(6/25-6/26)は▲0.115~▲0.10%程度、T/N(6/26-6/27)は▲0.13~▲0.11%程度で出合いが見られた。T/Nの取引は、短国買入オペの影響もあり、ややレートを下げて始まったが、その後やや売りが優勢となった。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。個別銘柄では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、短国買入オペが7,500億円で実施された。応札額が23,967億円程度と多かったものの、平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.002%とレポレートの下を受けて売り急ぎ動きがない中、先週に引き続き堅調な結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.14~▲0.138%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、3,300億円強の償還に對して、1,900億円弱の発行にとどまった。機械・ノンバンク業態からまとまったロットの発行が実施された。発行レートに目立った変動は無く、依然期越え物では旺盛な買い需要が観測された。

## ●短期金融市場関連指標

2018/6/25	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				-	▲ 0.108	0.025	0.000	22,338.15	▲ 178.68	109.93-95	109.46-48
T/N			0.000				-	▲ 0.126						
S/N							-	-						
1W			0.160				-	▲ 0.170						
2W							-	▲ 0.155						
3W							-	▲ 0.146						
1M			0.010				-	▲ 0.144						
3M							▲ 0.138	▲ 0.143						
6M							▲ 0.132	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.132	▲ 0.160						
									日付	6/18	6/19	6/20	6/21	6/22
									日銀当預残	3,870,700	3,878,000	3,931,500	3,932,800	3,913,100
									準備預金残	3,401,800	3,416,200	3,449,200	3,452,000	3,434,500
									マネタリーベース	4,954,200	4,961,900	5,016,300	5,019,400	5,001,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.069%	▲ 0.070%	▲ 0.073%	▲ 0.072%	▲ 0.075%
									コール市場残高	86,478	86,511	92,732	87,709	82,644
									うち無担	63,464	65,695	65,647	67,546	64,836
									うちO/N	34,964	37,265	36,057	36,016	33,526
									うち有担	23,014	20,816	27,085	20,163	17,808

## ●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
国庫短期証券買入	7,500	2018/6/26			23,967	7,503	▲0.002		▲0.001	94.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	41,983	2018/6/25	2018/6/26		329	329		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,000	2018/6/25	2018/6/26		100	100		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年6月26日の予定

*5月の企業向けサービス価格指数	*米国4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*20年利付国債入札(10,000億円、6/27発行)
	*米国6月のCB消費者信頼感指数	

◆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