

Central Daily Market Report

2018年6月26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26日		2018年6月27日		2018年6月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 900		▲ 11,300		2,000	
資金過不足	▲ 2,100		▲ 12,100		1,000	
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		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入			100			
国債補完供給	▲ 300	400		300		
当預増減	5,300		▲ 12,000		1,000	
当座預金残高	3,933,300		3,921,300		3,922,300	
準備預金残高	3,443,800					
積み終了先	3,443,500				6月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,443,500				積数	
非準備預金先	489,500				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		99.87%		日数	
					36.67%	

●2018年6月26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が弱い状況に変化はなく、一巡後は▲0.08%近辺の出合いが散見さ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(6/26-6/27)は▲0.11~▲0.10%程度、T/N(6/27-6/28)は▲0.11~▲0.10%程度で出合いが見られた。朝方から調達サイドがしっかりしており、前日よりやや高めめのレート目線となった。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。アウトライト市場は動意なく閑散で、3M物が▲0.15%、1Y物が▲0.135%で少額出合った程度だった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、発行・償還とも3,800億円前後であった。ノンバンク・不動産等から大型発行が見られたほか、複数の電力会社がまとまった発行を実施した。発行レートは概ね横ばい圏であった。CP等買入オペアは、事前予定通りの2,500億円でオファーされた。四半期末日スタートの買入となるオペアであったが、平均落札レートは前回比横ばいの▲0.002%、按分落札レートは前回から上昇し▲0.005%の結果となった。

●短期金融市場関連指標

2018/6/26	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.074				-	▲ 0.104	0.030	0.005	22,342.00	3.85	109.64-65	109.63-64	
T/N			0.000				-	▲ 0.115							
S/N							-	-							
1W							-	▲ 0.156							
2W							-	▲ 0.146							
3W							-	▲ 0.142							
1M							-	▲ 0.141							
3M							▲ 0.144	▲ 0.142							
6M							▲ 0.132	▲ 0.150							
1Y							▲ 0.132	▲ 0.160							
									日付		6/19	6/20	6/21	6/22	6/25
									日銀当預残		3,878,000	3,931,500	3,932,800	3,913,100	3,928,000
									準備預金残		3,416,200	3,449,200	3,452,000	3,434,500	3,441,100
									マネタリーベース		4,961,900	5,016,300	5,019,400	5,001,200	5,016,400
									無担O/N加重平均		▲0.070%	▲0.073%	▲0.072%	▲0.075%	▲0.073%
									コール市場残高		86,511	92,732	87,709	82,644	83,313
									うち無担		65,695	65,647	67,546	64,836	65,099
									うちO/N		37,265	36,057	36,016	33,526	33,979
									うち有担		20,816	27,085	20,163	17,808	18,214

●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)
20年利付国債	164	0.50%	10,000	2018/6/27	2038/3/20	35,069.0	8,286.00	99.8500	0.5080%	5.5369%	99.9300	0.5030%	1,707.0

●オペ結果

種類	オフター額(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
CP等買入	2,500	2018/6/29			5,740	2,465	▲0.005		▲0.002	28.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	68,333	2018/6/26	2018/6/27		298	298		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/6/28	2018/7/6	2.43	1	1				

●2018年6月27日の予定

*1-3月期の資金循環統計速報

*米国5月の耐久財新規受注

◆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