

Central Daily Market Report

2018年6月29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29日		2018年7月2日		2018年7月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		300		1,000	
財政	5,300		▲ 28,400		▲ 4,000	
資金過不足	4,500		▲ 28,100		▲ 3,000	
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			2,400	▲ 2,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,700			
CP等買入	2,500	▲ 3,600				
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	2,400		100			
国債補完供給	▲ 1,400	1,400	1,400			
当預増減	5,800		▲ 16,900		▲ 3,000	
当座預金残高	3,936,500		3,919,600		3,916,600	
準備預金残高	3,440,600					
積み終了先	3,440,400					
超過準備	3,440,300					
非準備預金先	495,900					
7月2日以降の残り所要積立額					積数	2,300
					1日平均	200
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,018,100
準備預金進捗率	実績	99.92%	日数	53.33%		

●2018年6月29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。四半期末日にあたることから調達を控える先も見られ、昨日よりも軟調な地合いとなった。一巡後は目立った出合いもなく今月の取引を終えた。ターム物に関しても目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オペは2W物8,000億円(7/2~7/17)がオファーされ、応札額2,382億円(期落ち分2,382億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(6/29-7/2)は▲0.11~▲0.10%程度、T/N(7/2-7/3)は▲0.11~▲0.09%程度で出合いが見られた。7月受渡の取引は調達サイドがしっかりしており、レートが小幅に上昇した。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、上昇した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において、▲0.14~▲0.129%の出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1319%、按分落札利回▲0.1263%と甘めの結果となった。セカンドラリーにおいては▲0.133~▲0.132%での出合いが見られた。この他には、6M物が▲0.135%、1Y物が▲0.132%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、600億円程の償還に対し、1,300億円の発行が見られ、石油業態がまとまった発行を実施した。発行レートは0%付近での決着が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/6/29	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)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.069				-	▲ 0.101	0.025	0.000	22,304.51	34.12	110.49-50	110.63-64
T/N			0.000				-	▲ 0.103						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.113						
2W	▲ 0.055	▲ 0.040	▲ 0.048				-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.121						
1M			0.010				-	▲ 0.126						
3M			0.005				▲ 0.132	▲ 0.136						
6M							▲ 0.132	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.132	▲ 0.159						
									日付	6/22	6/25	6/26	6/27	6/28
									日銀当預残	3,913,100	3,928,000	3,933,300	3,919,500	3,930,700
									準備預金残	3,434,500	3,441,100	3,443,800	3,424,500	3,429,700
									マネタリーベース	5,001,200	5,016,400	5,022,800	5,010,000	5,022,900
									無担O/N加重平均	▲0.075%	▲0.073%	▲0.074%	▲0.073%	▲0.071%
									コール市場残高	82,644	83,313	86,433	85,453	88,547
									うち無担	64,836	65,099	66,969	67,501	70,588
									うちO/N	33,526	33,979	35,964	36,681	41,518
									うち有担	17,808	18,214	19,464	17,952	17,959

●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	767	-	43,000	2018/7/2	2018/10/1	135,472.0	35,079.50	100.0315	▲0.1263%	3.0430%	100.0329	▲0.1319%	7,920.0

●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	2018/7/2	2018/7/17		2,382	2,382				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/7/2			11,561	2,506	0.002		0.003	54.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/7/2			8,926	3,004	0.003		0.003	63.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/7/2			14,827	4,106	0.006		0.007	30.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	115,771	2018/6/29	2018/7/2		1,314	1,314		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,410	2018/6/29	2018/7/2		0	0				

●2018年7月2日の予定

*6月調査の日銀短観	*米国5月の建設支出
	*米国6月のISM 製造業景況指数

◆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