

Central Daily Market Report

2018年6月5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5日		2018年6月6日		2018年6月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		600			0
財政	600		▲ 18,700			2,000
資金過不足	1,200		▲ 18,100			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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入	8,500					
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 100		▲ 200		
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 400	200		400		
当預増減	14,400		▲ 18,200			2,000
当座預金残高	3,776,900		3,758,700			3,760,700
準備預金残高	3,312,600					
積み終了先	3,312,500				6月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,312,500				積数	1,600
非準備預金先	464,300				1日平均	200
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額						3,124,900
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	67.74%		

●2018年6月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは邦銀・証券業態を中心に▲0.086～▲0.05%の調達が見られた。積み後半でも引き続き調達を控えている先が多くレートは低位横ばいとなった。一巡後は閑散で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物も調達を控えている先が多く、ショートタームのレートも低下していた。

<レポ市場>

GC T+0(6/5-6/6)は、▲0.110～▲0.100%程度の出合い。T/N(6/6-6/7)は、▲0.120～▲0.110%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。10Y336～349、5Y130～135などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは小幅に上昇した。アウトライト市場は、3M物が▲0.142～▲0.14%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は、発行総額500億円弱と閑散としたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。本日はCP等買入オペが2,500億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.003%・按分落札レート▲0.005%と、前日比(平均0.002%・按分▲0.004%)で両レートとも低下した。

●短期金融市場関連指標

2018/6/5	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				-	▲ 0.106	0.045	0.000	22,539.54	63.60	109.96-98	109.82-83
T/N			0.000				-	▲ 0.117						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	0.000	▲ 0.049				-	▲ 0.139						
2W	▲ 0.065	▲ 0.055	▲ 0.058				-	▲ 0.142						
3W	0.001	0.035	0.024				-	▲ 0.144						
1M							-	▲ 0.158						
3M	▲ 0.027	0.001	▲ 0.023				▲ 0.140	▲ 0.155						
6M							▲ 0.130	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.136	▲ 0.162						
									日付	5/29	5/30	5/31	6/1	6/4
									日銀当預残	3,841,800	3,836,100	3,842,400	3,809,700	3,762,500
									準備預金残	3,360,400	3,351,800	3,351,900	3,316,800	3,290,700
									マネタリーベース	4,925,900	4,920,100	4,926,700	4,894,500	4,846,400
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.070%	▲0.065%	▲0.072%	▲0.071%
									コール市場残高	77,024	78,816	68,231	79,794	77,236
									うち無担	61,135	62,356	56,000	64,083	60,070
									うちO/N	34,645	34,936	30,270	37,603	33,490
									うち有担	15,889	16,460	12,231	15,711	17,166

●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)
10年利付国債	350	0.10%	22,000	2018/6/6	2028/3/20	78,819.0	18,014.00	100.4900	0.0490%	94.4896%	100.5000	0.0480%	3,972.0

●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
CP等買入	2,500	2018/6/8			6,972	2,487	▲0.005		▲0.003	34.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	64,544	2018/6/5	2018/6/6		355	355		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	14,650	2018/6/5	2018/6/6		1	1		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/6/7	2018/6/14	2.2	1	1				

●2018年6月6日の予定

*4月の毎月勤労統計調査速報	*米国4月の貿易収支	*交付税特別会計借入(10,500億円、6/14借入)
----------------	------------	-----------------------------

◆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