Central Daily Market Report

2018年6月27日（水）
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27日 需給速報		2018年6月28日 需給予想		2018年6月29日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,800		▲ 2,100	
財政	▲ 12,800		5,300		3,400	
資金過不足	▲ 13,800		3,500		1,300	
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						
国債買入			8,700			
CP等買入		▲ 300		▲ 100	2,500	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入	100		400			
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当預増減	▲ 13,800		12,600		3,800	

当座預金残高	3,919,500	3,932,100	3,935,900
準備預金残高	3,424,500		
積み終了先	3,424,300		
超過準備	3,424,300		
非準備預金先	495,000		

6月28日以降の残り所要積立額	
積数	3,600
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	99.88%	日数 40.00%

●2018年6月27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(6/27-6/28)は▲0.115～▲0.10%程度、T/N(6/28-6/29)は▲0.125～▲0.10%程度で出合が見られた。国債買入オペの影響もあり、前日よりやや低めのレート水準で出合いがあった。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特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、2営業日後が四半期末日にあたり、2兆5,000億円強の償還に対して、1兆円程度の発行にとどまる大幅な償還超となった。商社・ゴム・ノンバンク等はまとまったロットの発行を実施した。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/6/27	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.073				－	▲ 0.111
T/N			0.000				－	▲ 0.118
S/N							－	－
1W			▲ 0.065				－	▲ 0.146
2W			▲ 0.055				－	▲ 0.140
3W							－	▲ 0.136
1M							－	▲ 0.135
3M							▲ 0.143	▲ 0.137
6M							▲ 0.132	▲ 0.149
1Y							▲ 0.132	▲ 0.160

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.030	0.000	22,271.77	▲ 70.23	110.12-14	109.72-73

日付	6/20	6/21	6/22	6/25	6/26
日銀当預残	3,931,500	3,932,800	3,913,100	3,928,000	3,933,300
準備預金残	3,449,200	3,452,000	3,434,500	3,441,100	3,443,800
マネタリーベース	5,016,300	5,019,400	5,001,200	5,016,400	5,022,800
無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.072%	▲0.075%	▲0.073%	▲0.074%
コール市場残高	92,732	87,709	82,644	83,313	86,433
うち無担	65,647	67,546	64,836	65,099	66,969
うちO/N	36,057	36,016	33,526	33,979	35,964
うち有担	27,085	20,163	17,808	18,214	19,464

●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Ⅰ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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	2,500	2018/6/28			13,742	2,513	0.005		0.005	83.3
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,000	2018/6/28			11,717	3,011	▲0.002		▲0.001	12.5
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,900	2018/6/28			6,006	1,922	▲0.003		▲0.002	64.9
国債買入（残存期間25年超）	700	2018/6/28			2,483	707	▲0.002		▲0.002	58.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	7,617	2018/6/27	2018/6/28		5	5		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	8,282	2018/6/27	2018/6/28		112	112		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月28日の予定

*5月の商業動態統計速報
*米国1-3月期のGDP確報値
*2年利付国債入札（21,000億円、7/2発行）

◆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。
◆本資料は何ら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