

Central Daily Market Report

2018年6月28日(木)

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28日		2018年6月29日		2018年7月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 900			1,000
財政	5,200		5,700			▲ 21,000
資金過不足	3,500		4,800		▲ 20,000	
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
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		▲ 100	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						
ETF買入	400		2,400			
国債補完供給	▲ 1,400	100		1,400		
当預増減	11,200		7,500		▲ 22,400	
当座預金残高	3,930,700		3,938,200		3,915,800	
準備預金残高	3,430,800					
積み終了先	3,430,500				6月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,430,500				積数 3,300	
非準備預金先	499,900				1日平均 200	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,017,000	
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	43.33%		

●2018年6月28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、一巡後は目立った出合いもなく本日の取引を終えた。ターム物に関しては7月スタートのショートターム物で▲0.06%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(6/28-6/29)は▲0.115~▲0.10%程度、T/N(6/29-7/2)は▲0.15~▲0.10%程度で出合いが見られた。T/Nの取引は四半期末初にあたったが、調達サイドがしっかりしており、レートの低下は限定的だった。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見立った。

<短国市場>

現先T/Nは、末初に該当したがレート低下は限定的だった。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営業日後が四半期初日にあたり、住宅・石油・鉄鋼・機械等幅広い業態が大ロットでの発行を実施した。そのため償還は800億円強と比較的少額であったものの、発行は1兆1,000億円以上見られる活況なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2018/6/28	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	▲ 0.071				-	▲ 0.107	0.025	▲ 0.005	22,270.39	▲ 1.38	110.21-22	110.34-35
T/N							-	▲ 0.118						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.129						
2W	▲ 0.060	0.160	▲ 0.041				-	▲ 0.125						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.126						
1M	▲ 0.055	0.002	▲ 0.018				-	▲ 0.129						
3M							▲ 0.142	▲ 0.136						
6M							▲ 0.132	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.132	▲ 0.160						
									日付	6/21	6/22	6/25	6/26	6/27
									日銀当預残	3,932,800	3,913,100	3,928,000	3,933,300	3,919,500
									準備預金残	3,452,000	3,434,500	3,441,100	3,443,800	3,424,500
									マナタリベース	5,019,400	5,001,200	5,016,400	5,022,800	5,010,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.072%	▲ 0.075%	▲ 0.073%	▲ 0.074%	▲ 0.073%
									コール市場残高	87,709	82,644	83,313	86,433	85,453
									うち無担	67,546	64,836	65,099	66,969	67,501
									うちO/N	36,016	33,526	33,979	35,964	36,681
									うち有担	20,163	17,808	18,214	19,464	17,952

●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)
2年利付国債	390	0.10%	21,000	2018/7/2	2020/7/1	85,824.0	17,574.00	100.4550	▲0.1270%	81.3815%	100.4580	▲0.1280%	3,418.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	80,878	2018/6/28	2018/6/29		1,052	1,052		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	4,083	2018/6/28	2018/6/29		374	374		▲0.600	▲0.600	

●2018年6月29日の予定

*5月の完全失業率(市場予想：2.5%) *5月の有効求人倍率(市場予想：1.59倍)
 *5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲1.1%)
 *6月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.6%)
 *5月の消費動向調査 *5月の住宅着工統計

*米国5月の個人所得・消費支出
 *米国6月のシカゴPM景況感指数
 *英国1-3月期のGDP確報値
 *ユーロ圏6月の消費者物価指数速報

*国庫短期証券(767回)入札(3ヶ月、43,000億円、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