

# Central Daily Market Report

2018年7月2日(月)

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7月2日		2018年7月3日		2018年7月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 300		0	
財政	▲ 27,800		▲ 8,500		▲ 47,000	
資金過不足	▲ 27,400		▲ 8,800		▲ 47,000	
<b>金融調節</b>						
	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						
国庫短期証券買入			5,000			
国債買入	9,700		3,400			
CP等買入						
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	▲ 1,400	1,400		1,400		
当預増減	▲ 17,600		1,000		▲ 47,000	
当座預金残高	3,918,900		3,919,900		3,872,900	
準備預金残高	3,416,600					
積み終了先	3,416,400		7月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,416,400		積数		2,100	
非準備預金先	502,300		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	99.93%	日数	56.67%		

## ●2018年7月2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~▲0.050%での調達で始まった。月末要因が剥落し、ビッドサイドの調達量は回復したものの、出会い水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は目立った出合いは見られず、本日の取引を終えた。ターム物に関してはショートターム物が▲0.070~▲0.065%程度の出合いが見られていた。

### <レポ市場>

GC T+0(7/2-7/3)は▲0.11~▲0.10%程度の気配、T/N(7/3-7/4)は▲0.105~▲0.095%程度での出合いとなった。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。アウトライト市場では、短国買入オペが5,000億円で実施された。平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.002%と堅調な結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.136~▲0.135%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は小売、ノンバンク業態からまたまった発行が見られたものの、全体の発行額は700億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/7/2	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	▲ 0.074				-	▲ 0.101	0.020	▲ 0.005	21,811.93	▲ 492.58	110.73-74	110.73-74
T/N			0.000				-	▲ 0.103						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.032	▲ 0.062				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.070	0.000	▲ 0.045				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.116						
1M	▲ 0.025	0.030	▲ 0.015				-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.135	▲ 0.132						
6M							▲ 0.131	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.132	▲ 0.159						
									日付	6/25	6/26	6/27	6/28	6/29
									日銀当預残	3,928,000	3,933,300	3,919,500	3,930,700	3,936,500
									準備預金残	3,441,100	3,443,800	3,424,500	3,429,700	3,440,600
									マネタリーベース	5,016,400	5,022,800	5,010,000	5,022,900	5,029,400
									無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.074%	▲0.073%	▲0.071%	▲0.069%
									コール市場残高	83,313	86,433	85,453	88,547	64,720
									うち無担	65,099	66,969	67,501	70,588	42,579
									うちO/N	33,979	35,964	36,681	41,518	27,059
									うち有担	18,214	19,464	17,952	17,959	22,141

## ●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1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
国庫短期証券買入	5,000	2018/7/3			17,342	5,003	▲0.002		▲0.001	17.1
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/7/3			4,002	500	0.018		0.018	98.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/7/3			5,939	1,907	0.002		0.002	64.9
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/7/3			2,441	707	0.002		0.002	83.0
国債買入(物価連動債)	250	2018/7/3			1,958	252	▲0.060		▲0.069	44.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	92,048	2018/7/2	2018/7/3		769	769		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	112,240	2018/7/2	2018/7/3		551	551		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年7月3日の予定

*6月のマネタリーベース	*米国5月の製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(22,000億円、7/4発行)
*6月実績/7月見込み財政資金対民間収支		

◆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