

Central Daily Market Report

2018年7月3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7月3日		2018年7月4日		2018年7月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		300		0	
財政	▲ 6,000		▲ 48,700		1,000	
資金過不足	▲ 6,200		▲ 48,400		1,000	
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	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	▲ 200	1,400		200		
当預増減	3,400		▲ 48,100		1,000	
当座預金残高	3,922,300		3,874,200		3,875,200	
準備預金残高	3,422,100					
積み終了先	3,422,000				7月4日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,422,000				積数	
非準備預金先	500,200				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	60.00%		

●2018年7月3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。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で▲0.070~▲0.065%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(7/3-7/4)は▲0.10~▲0.095%程度の気配、T/N(7/4-7/5)は▲0.105~▲0.095%程度で出合となった。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、40y11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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.139~▲0.137%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5日発行となり、商社、鉄鋼、ノンバンク業態から大型の発行が見られ、総額2,800億円程度に膨らんだ。発行レートは引続き横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/7/3	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.073				-	▲ 0.099	0.035	0.015	21,785.54	▲ 26.39	110.88-89	110.98-99
T/N			0.000				-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.020	▲ 0.061				-	▲ 0.107						
2W	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.110						
3W	0.000	0.035	0.004				-	▲ 0.114						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.135	▲ 0.129						
6M							▲ 0.130	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.158						
									日付	6/26	6/27	6/28	6/29	7/2
									日銀当預残	3,933,300	3,919,500	3,930,700	3,936,500	3,918,900
									準備預金残	3,443,800	3,424,500	3,429,700	3,440,600	3,416,600
									マネタリーベース	5,022,800	5,010,000	5,022,900	5,029,400	5,011,500
									無担O/N加重平均	▲0.074%	▲0.073%	▲0.071%	▲0.069%	▲0.074%
									コール市場残高	86,433	85,453	88,547	64,720	91,014
									うち無担	66,969	67,501	70,588	42,579	71,968
									うちO/N	35,964	36,681	41,518	27,059	45,543
									うち有担	19,464	17,952	17,959	22,141	19,046

●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	351	0.10%	22,000	2018/7/4	2028/6/20	77,823.0	17,825.00	100.6000	0.0390%	38.2288%	100.6200	0.0370%	4,154.0

●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)	13,027	2018/7/3	2018/7/4		179	179		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/7/6	2018/7/12	2.42	1	1				

●2018年7月4日の予定

*原田日銀審議委員、石川県金融経済懇談会にて講演
*7月の日銀当座預金増減要因見込み

*New York祝日(Independence Day)

◆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