

Central Daily Market Report

2018年7月5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7月5日		2018年7月6日		2018年7月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 300		1,000	
財政	▲ 1,800		▲ 6,300		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 2,200		▲ 6,600		0	
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						▲ 1,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,900					
CP等買入		▲ 300		▲ 100		
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			1,100			
国債補完供給	▲ 1,000	200		1,000		
当預増減	6,600		▲ 4,600		▲ 1,400	
当座預金残高	3,878,000		3,873,400		3,872,000	
準備預金残高	3,382,700					
積み終了先	3,382,500				7月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,382,500				積数	1,700
非準備預金先	495,300				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	99.94%	日数	66.67%		

●2018年7月5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~▲0.050%での調達が始まった。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▲0.055%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(7/5-7/6)は▲0.10~▲0.095%程度の出合い、T/N(7/6-7/9)は▲0.105~▲0.095%程度で出合いとなった。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、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>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は商社業態から大型の発行が見られ、総額2,100億円程度に膨らんだ。発行レートは引続き横ばいで推移した。本日2,000億円で実施されたCP等買入オペは、平均レート0.000%、按分レート▲0.003%といずれも前回オペ比で上昇した。

●短期金融市場関連指標

2018/7/5	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	▲ 0.072				-	▲ 0.100	0.030	0.000	21,546.99	▲ 170.05	110.50-51	110.65-66
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.040	▲ 0.048				-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.055				-	▲ 0.107						
3W			0.000				-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.140	▲ 0.129						
6M							▲ 0.130	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.158						
									日付	6/28	6/29	7/2	7/3	7/4
									日銀当預残	3,930,700	3,936,500	3,918,900	3,922,300	3,871,400
									準備預金残	3,429,700	3,440,600	3,416,600	3,422,100	3,378,600
									マネタリーベース	5,022,900	5,029,400	5,011,500	5,015,100	4,963,800
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.069%	▲0.074%	▲0.073%	▲0.073%
									コール市場残高	88,547	64,720	91,014	99,703	107,092
									うち無担	70,588	42,579	71,968	75,261	79,370
									うちO/N	41,518	27,059	45,543	47,381	50,330
									うち有担	17,959	22,141	19,046	24,442	27,722

●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)
30年利付国債	59	0.70%	7,000	2018/7/6	2048/6/20	28,210.0	5,633.00	99.8500	0.7060%	31.2024%	99.9000	0.7040%	1,360.0

●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	2,000	2018/7/10			6,111	1,981	▲0.003		0.000	37.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	57,197	2018/7/5	2018/7/6		973	973		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,231	2018/7/5	2018/7/6		17	17		▲0.600	▲0.600	

●2018年7月6日の予定

- *5月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比▲1.5%)
- *5月の毎月勤労統計調査速報
- *5月の景気動向指数速報
- *6月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国5月の貿易収支
- *米国6月の雇用統計
- *国庫短期証券(768回)入札 (3ヶ月、42,800億円、7/9発行)
- *交付税特別会計借入 (10,500億円、7/20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