

# Central Daily Market Report

2018年7月6日(金)

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6日		2018年7月9日		2018年7月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		1,200			0
財政	▲ 7,100		1,500			▲ 1,000
資金過不足	▲ 7,200		2,700			▲ 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			1,300	▲ 1,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,600			
CP等買入		▲ 100		▲ 200	2,000	
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	▲ 1,200	1,000		1,200		
当預増減	▲ 6,400		12,200			1,000
当座預金残高	3,871,600		3,883,800			3,884,800
準備預金残高	3,387,000					
積み終了先	3,386,800				7月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,386,800				積数	1,000
非準備預金先	484,600				1日平均	100
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,031,300
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	76.67%		

## ●2018年7月6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。週末を挟む取引であるものの、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で▲0.055%程度の出合いが見られていた。

### <レポ市場>

GC T+0(7/6-7/9)は▲0.095~▲0.09%程度の出合い、T/N(7/9-7/10)は▲0.10~▲0.085%程度での出合いとなった。T/NはTDB3M物発行の影響で業者の売物が増加している。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10Y336~351、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、上昇した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において、▲0.135%から▲0.145%まで買い進められたことを受けてか、入札結果は平均落札利回▲0.1380%、按分落札利回▲0.1328%と事前予想よりも強めの結果となった。セカンダリーにおいても▲0.145~▲0.142%での強めの出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は10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

2018/7/6	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	▲ 0.069				-	▲ 0.094	0.025	▲ 0.005	21,788.14	241.15	110.55-57	110.57-58
T/N			0.000				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.058	▲ 0.040	▲ 0.053				-	▲ 0.101						
2W	▲ 0.055	0.000	▲ 0.035				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.112						
1M			0.050				-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.142	▲ 0.129						
6M							▲ 0.130	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.158						
									日付	6/29	7/2	7/3	7/4	7/5
									日銀当預残	3,936,500	3,918,900	3,922,300	3,871,400	3,878,000
									準備預金残	3,440,600	3,416,600	3,422,100	3,378,600	3,382,700
									マネタリーベース	5,029,400	5,011,500	5,015,100	4,963,800	4,970,800
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.074%	▲0.073%	▲0.073%	▲0.072%
									コール市場残高	64,720	91,014	99,703	107,092	105,047
									うち無担	42,579	71,968	75,261	79,370	80,846
									うちO/N	27,059	45,543	47,381	50,330	50,731
									うち有担	22,141	19,046	24,442	27,722	24,201

## ●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)
国庫短期証券	768	-	42,800	2018/7/9	2018/10/9	179,557.0	34,771.3	100.0335	▲0.1328%	86.9767%	100.0348	▲0.1380%	8,028.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/7/20	2019/1/18	222,777.0	10,500.15		0.0000%	4.7134%		0.0000%	

## ●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2018/7/9	2018/7/23		1,311	1,311				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/7/9			10,969	2,505	0.004		0.005	35.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/7/9			14,397	3,004	0.003		0.003	93.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/7/9			6,360	1,910	▲0.003		▲0.003	99.9
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/7/9			2,447	702	▲0.009		▲0.008	90.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	46,567	2018/7/6	2018/7/9		782	782		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,654	2018/7/6	2018/7/9		318	318		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年7月9日の予定

*5月の国際収支	*米国5月の消費者信用残高	*国庫短期証券(769回)入札(6ヶ月、23,000億円、7/10発行)
*6月の景気ウォッチャー調査		

◆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