

# Central Daily Market Report

2018年7月10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10日		2018年7月11日		2018年7月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		300		▲ 1,000	
財政	1,000		▲ 29,600		▲ 18,000	
資金過不足	1,100		▲ 29,300		▲ 19,000	
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			7,500			
国債買入						
CP等買入	2,000	▲ 100		▲ 200		
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			500			
国債補完供給		200				
当預増減	3,200		▲ 21,500		▲ 19,000	
当座預金残高	3,887,500		3,866,000		3,847,000	
準備預金残高	3,434,500					
積み終了先	3,434,300				7月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,434,300				積数	600
非準備預金先	453,000				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	99.98%	日数	83.33%		

## ●2018年7月10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。一巡後は調整から▲0.085%程度の出合いが散見された程度で、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~▲0.050%程度の出合いが見られていた。

### <レポ市場>

GC T+0(7/10-7/11)は▲0.085~▲0.080%程度の出合い、T/N(7/11-7/12)は▲0.090~▲0.085%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10Y336~351、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、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7,500億円で実施された。平均落札利回較差+0.001%、按分落札利回較差±0.000%と堅調なマーケットを反映した結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.147~▲0.145%、6M物が▲0.148%、1Y物が▲0.132%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、不動産・石油・卸売・その他金融など複数の業態から大型の案件が見られ、発行総額は2,300億円程度まで膨らんだ。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

2018/7/10	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	▲ 0.071				-	▲ 0.088	0.035	0.010	22,196.89	144.71	110.95-96	111.07-09
T/N			0.000				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.096						
2W							-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.144	▲ 0.130						
6M							▲ 0.147	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.157						
									日付	7/3	7/4	7/5	7/6	7/9
									日銀当預残	3,922,300	3,871,400	3,878,000	3,871,600	3,884,300
									準備預金残	3,422,100	3,378,600	3,382,700	3,387,000	3,421,900
									マネタリーベース	5,015,100	4,963,800	4,970,800	4,964,500	4,976,100
									無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.073%	▲0.072%	▲0.069%	▲0.071%
									コール市場残高	99,703	107,092	105,047	105,275	110,479
									うち無担	75,261	79,370	80,846	74,870	77,684
									うちO/N	47,381	50,330	50,731	44,955	47,869
									うち有担	24,442	27,722	24,201	30,405	32,795

## ●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)
5年利付国債	136	0.10%	20,000	2018/7/11	2023/6/20	80,384.0	16,508.00	101.0200	▲0.1050%	39.4402%	101.0300	▲0.1070%	3,481.0

## ●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
国庫短期証券買入	7,500	2018/7/11			23,486	7,503	0.000		0.001	75.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	6,570	2018/7/10	2018/7/11		2	2		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/7/12	2018/7/19	2.41	0	0				

## ●2018年7月11日の予定

*5月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲5.5%)	*米国5月の卸売売上高 *米国6月の生産者物価指数	*エネルギー対策借入 (7,000億円、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