

Central Daily Market Report

2018年7月11日(水)
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11日		2018年7月12日		2018年7月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 30,400		▲ 20,600		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 30,000		▲ 21,700		▲ 3,000	
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			9,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 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		800			
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	▲ 22,400		▲ 11,200		▲ 3,000	
当座預金残高	3,865,100		3,853,900		3,850,900	
準備預金残高	3,417,200					
積み終了先	3,417,100		7月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,417,100		積数		500	
非準備預金先	447,900		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	86.67%		

●2018年7月11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~▲0.040%での調達が始まった。一巡後は調整から▲0.086~▲0.045%程度で散発的な出合いが見られていた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.050%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(7/11-7/12)は▲0.090~▲0.085%程度の出合い、T/N(7/12-7/13)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、石油・機械・その他金融などの業態から大型発行があり、償還総額450億円に対して、発行総額は2,300億円程度と発行超のマーケットとなった。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

2018/7/11	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	▲ 0.068				-	▲ 0.090	0.035	0.000	21,932.21	▲ 264.68	110.85-86	111.00-02
T/N			0.000				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.065				-	▲ 0.099						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.112						
1M							-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.144	▲ 0.130						
6M							▲ 0.147	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.157						
									日付	7/4	7/5	7/6	7/9	7/10
									日銀当預残	3,871,400	3,878,000	3,871,600	3,884,300	3,887,500
									準備預金残	3,378,600	3,382,700	3,387,000	3,421,900	3,434,500
									マネタリーベース	4,963,800	4,970,800	4,964,500	4,976,100	4,979,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.073%	▲ 0.072%	▲ 0.069%	▲ 0.071%	▲ 0.071%
									コール市場残高	107,092	105,047	105,275	110,479	108,237
									うち無担	79,370	80,846	74,870	77,684	80,428
									うちO/N	50,330	50,731	44,955	47,869	49,713
									うち有担	27,722	24,201	30,405	32,795	27,809

●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)
エネルギー対策	-	-	7,000	2018/7/20	2019/7/22	111,591.0	6,999.90		0.0000%	6.2729%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/7/12			9,202	2,508	0.001		0.002	39.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/7/12			11,419	3,005	0.002		0.003	28.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/7/12			18,675	4,108	0.003		0.003	33.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	22,398	2018/7/11	2018/7/12		163	163		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年7月12日の予定

*米国6月の消費者物価指数	*20年利付国債入札
*米国6月の財政収支	(10,000億円、7/13発行)

◆本資料は信頼できるとさ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