

Central Daily Market Report

2018年7月4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4日		2018年7月5日		2018年7月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 500			0
財政	▲ 51,400		▲ 100		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 51,000		▲ 600		▲ 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						
国債買入			9,900			
CP等買入				▲ 300		
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	200		200		
当預増減	▲ 50,900		9,200		▲ 3,000	
当座預金残高	3,871,400		3,880,600		3,877,600	
準備預金残高	3,378,600					
積み終了先	3,378,400					
超過準備	3,378,400					
非準備預金先	492,800					
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	63.33%		

●2018年7月4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。税揚げ日にあたりある程度のビッドの増加が見られたが、レートの上昇には至らなかった。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~▲0.050%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(7/4-7/5)は▲0.10~▲0.095%程度の出合い、T/N(7/5-7/6)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。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、3M物が▲0.14~▲0.139%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は電機、石油、自動車業態からまたまった発行が見られ、発行件数は少ないものの総額2,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/7/4	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	▲ 0.073				-	▲ 0.097	0.030	▲ 0.005	21,717.04	▲ 68.50	110.40-42	110.47-48
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.106						
2W			0.020				-	▲ 0.108						
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	6/27	6/28	6/29	7/2	7/3
									日銀当預残	3,919,500	3,930,700	3,936,500	3,918,900	3,922,300
									準備預金残	3,424,500	3,429,700	3,440,600	3,416,600	3,422,100
									マネタリーベース	5,010,000	5,022,900	5,029,400	5,011,500	5,015,100
									無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.071%	▲0.069%	▲0.074%	▲0.073%
									コール市場残高	85,453	88,547	64,720	91,014	99,703
									うち無担	67,501	70,588	42,579	71,968	75,261
									うちO/N	36,681	41,518	27,059	45,543	47,381
									うち有担	17,952	17,959	22,141	19,046	24,442

●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	2018/7/5			13,215	2,505	0.004		0.004	91.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/7/5			9,564	3,005	0.001		0.001	72.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/7/5			14,599	4,115	▲0.003		▲0.002	29.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	18,445	2018/7/4	2018/7/5		234	234		▲0.600	▲0.600	

●2018年7月5日の予定

*政井日銀審議委員、長野県金融経済懇談会にて講演	*米国6月のISM非製造業景況指数	*30年利付国債入札(7,000億円、7/6発行)
--------------------------	-------------------	---------------------------

◆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