

Central Daily Market Report

2018年7月17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17日		2018年7月18日		2018年7月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		900			0
財政	7,700		2,100			▲2,000
資金過不足	8,400		3,000			▲2,000
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	2,900	▲2,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	6,900		5,800			
CP等買入		▲700	2,000	▲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		▲100				
E T F買入	600		1,000			
国債補完供給	▲1,000	300	1,000			
当預増減	14,900		17,700			▲2,000
当座預金残高	3,868,000		3,885,700			3,883,700
準備預金残高	3,394,000					
積み終了先	3,282,500				7月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,930,100				積数	129,200
非準備預金先	474,000				1日平均	4,500
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額						3,129,300
準備預金進捗率	実績	95.87%	日数	6.45%		

●2018年7月17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~▲0.040%近辺の幅広いレート帯での調達で始まった。実質的な新しい積みの初日ということもあり、調達側から取り急ぐ姿は見られなかった。一巡後は▲0.086~▲0.055%程度で散発的な出会いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.055~▲0.050%程度の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(7/17-7/18)は▲0.095~▲0.090%程度の出合い、T/N(7/18-7/19)は▲0.115~▲0.105%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10Y336~351、5Y130~136、40Y11などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは横ばいで推移した。アウトライト市場では、短国買入オペアが5,000億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.002%と小じつかりの結果となった。マーケットでは3M物が▲0.15~▲0.148%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額500億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と発行超であった。一部の卸売業態で大型案件が見られたものの、案件数は膨らまず落ち着いたマーケットとなった。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

2018/7/17	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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				-	▲0.097	0.035	0.000	22,697.36	100.01	112.37-38	112.34-35
T/N			0.000				-	▲0.108						
S/N							-	-						
1W	▲0.060	0.001	▲0.038				-	▲0.111						
2W	▲0.055	▲0.010	▲0.048				-	▲0.116						
3W			▲0.060				-	▲0.119						
1M							-	▲0.124						
3M			0.070				▲0.150	▲0.132						
6M							▲0.147	▲0.149						
1Y							▲0.130	▲0.157						
									日付	7/9	7/10	7/11	7/12	7/13
									日銀当預残	3,884,300	3,887,500	3,865,100	3,852,200	3,853,100
									準備預金残	3,421,900	3,434,500	3,417,200	3,429,100	3,390,100
									マネタリーベース	4,976,100	4,979,200	4,956,500	4,944,700	4,946,100
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.071%	▲0.068%	▲0.064%	▲0.065%
									コール市場残高	110,479	108,237	114,258	118,813	103,278
									うち無担	77,684	80,428	82,935	87,184	74,977
									うちO/N	47,869	49,713	51,920	56,119	45,252
									うち有担	32,795	27,809	31,323	31,629	28,301

●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
国庫短期証券買入	5,000	2018/7/18			15,149	5,003	▲0.002		▲0.001	72.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/7/18			13,391	2,500		0.004	0.004	
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/7/18			10,850	3,008	0.002		0.003	12.7
国債買入(物価連動債)	250	2018/7/18			1,867	251	▲0.130		▲0.157	36.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	101,831	2018/7/17	2018/7/18		784	784		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	59,783	2018/7/17	2018/7/18		183	183		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/7/19	2018/7/26	2.42						

●2018年7月18日の予定

*米国ベージュブック	*流動性供給入札 (6,000億円、7/19発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、7/26借入)
*米国6月の住宅着工件数		
*ユーロ圏6月の消費者物価指数改定値		
*英国6月の消費者物価指数		

◆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