

Central Daily Market Report

2018年7月18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18日 需給速報	2018年7月19日 需給予想	2018年7月20日 当社予想
銀行券	1,100	▲ 600	▲ 1,000
財政	2,900	▲ 4,400	▲ 6,000
資金過不足	4,000	▲ 5,000	▲ 7,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	5,000		
国債買入	5,800		
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			1,100
E T F 買入	1,000		▲ 1,100
国債補完供給	▲ 300	1,000	300
当預増減	18,400	▲ 5,000	▲ 7,000
当座預金残高	3,886,400	3,881,400	3,874,400
準備預金残高	3,404,700		
積み終了先	3,364,300		
超過準備	3,341,900		
非準備預金先	481,700		
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	97.88%	日数
			9.68%

●2018年7月18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%近辺の調達で始まった。調達意欲は弱く、一巡後の出合い水準は▲0.086~▲0.080%程度で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は出合いが閑散であった。

<レポ市場>

GC T+0(7/18-7/19)は▲0.150~▲0.095%程度の出合い、T/N(7/19-7/20)は▲0.140~▲0.120%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は小幅に低下した。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、6M物が▲0.155%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。CP発行市場は償還総額1,500億円程度に対して、発行総額は3,000億円強と発行超であった。5・10日発行となり輸送用機器・鉄鋼業態において大型案件が見られ、比較的活況な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

2018/7/18	無担(速報)			有担(速報)			短国 先買参考統計値	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	▲ 0.120	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.133	0.040	0.005	22,794.19	96.83	113.01-02	113.05-07
T/N			0.000				-	▲ 0.128						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.045				-	▲ 0.127						
2W							-	▲ 0.130						
3W							-	▲ 0.130						
1M			▲ 0.013				-	▲ 0.133						
3M							▲ 0.150	▲ 0.137						
6M							▲ 0.147	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.157						
									日付	7/10	7/11	7/12	7/13	7/17
									日銀当預残	3,887,500	3,865,100	3,852,200	3,853,100	3,868,000
									準備預金残	3,434,500	3,417,200	3,429,100	3,390,100	3,394,000
									マネタリーベース	4,979,200	4,956,500	4,944,700	4,946,100	4,960,300
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.068%	▲0.064%	▲0.065%	▲0.072%
									コール市場残高	108,237	114,258	118,813	103,278	99,481
									うち無担	80,428	82,935	87,184	74,977	74,508
									うちO/N	49,713	51,920	56,119	45,252	48,513
									うち有担	27,809	31,323	31,629	28,301	24,973

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
流動性供給	265	-	6,000	2018/7/19		23,599.0	5,977.00		▲0.0010%	69.8440%		▲0.0030%	
交付税特会	-	-	10,500	2018/7/26	2019/1/28	213,389.0	10,500.09		0.0000%	4.9484%		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	入札総額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	32,239	2018/7/18	2018/7/19		272	272		▲0.600	▲0.600	

●2018年7月19日の予定

*月例経済報告 *6月の貿易統計	*国庫短期証券(771回)入札 (1年、21,000億円、7/20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