

Central Daily Market Report

2018年7月19日(木)

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19日 需給速報	2018年7月20日 需給予想	2018年7月23日 当社予想
銀行券	▲ 500	▲ 200	0
財政	0	▲ 10,100	▲ 4,000
資金過不足	▲ 500	▲ 10,300	▲ 4,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 1,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		6,800	
CP等買入	▲ 200	▲ 300	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援		1,100	▲ 1,100
社債等買入	▲ 100	▲ 100	
ETF買入		100	
国債補完供給	▲ 400	300	400
当預増減	▲ 900	▲ 3,400	▲ 5,300
当座預金残高	3,885,500	3,882,100	3,876,800
準備預金残高	3,401,700		
積み終了先	3,378,300		
超過準備	3,373,800		
非準備預金先	483,800		
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	98.77%	日数
			12.90%

●2018年7月19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。昨日と同様に、一巡後は▲0.086~▲0.080%の出会い水準で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件中心の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(7/19-7/20)は▲0.120~▲0.100%程度 of 出会い、T/N(7/20-7/23)は▲0.150~▲0.130%程度で出会いとなった。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、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.145%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1440%、按分落札利回▲0.1420%と強めの結果となった。セカンダリーでは、▲0.16~▲0.147%と広いレンジでの出会いが見られた。この他に、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。発行市場は償還総額500億円強に対して、発行総額は1,000億円強と若干の発行超であった。卸売業態において大型案件は見られたものの、案件数は少なく盛り上がり欠けるマーケットであった。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

2018/7/19	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	▲ 0.072				-	▲ 0.129	0.035	▲ 0.005	22,764.68	▲ 29.51	112.80-81	112.96-98
T/N	0.000	0.001	0.001				-	▲ 0.141						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.020	▲ 0.049				-	▲ 0.137						
2W	▲ 0.050	▲ 0.010	▲ 0.040				-	▲ 0.138						
3W							-	▲ 0.139						
1M							-	▲ 0.140						
3M							▲ 0.152	▲ 0.142						
6M							▲ 0.150	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.158						
									日付	7/11	7/12	7/13	7/17	7/18
									日銀当預残	3,865,100	3,852,200	3,853,100	3,868,000	3,886,400
									準備預金残	3,417,200	3,429,100	3,390,100	3,394,000	3,404,700
									マネタリーベース	4,956,500	4,944,700	4,946,100	4,960,300	4,977,600
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.064%	▲0.065%	▲0.072%	▲0.072%
									コール市場残高	114,258	118,813	103,278	99,481	91,651
									うち無担	82,935	87,184	74,977	74,508	70,220
									うちO/N	51,920	56,119	45,252	48,513	44,875
									うち有担	31,323	31,629	28,301	24,973	21,431

●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)
国庫短期証券	771	-	21,000	2018/7/20	2019/7/22	101,763.0	17,684.60	100.1430	▲0.1420%	79.3054%	100.1450	▲0.1440%	3,315.0

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/7/20			9,805	4,109	▲0.003		▲0.002	29.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/7/20			5,309	1,804	▲0.002		0.000	38.3
国債買入(残存期間25年超)	600	2018/7/20			2,526	603	0.001		0.001	99.3
社債等買入	1,000	2018/7/25			2,229	1,001	▲0.149		▲0.119	96.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	62,287	2018/7/19	2018/7/20		339	339		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	3,097	2018/7/19	2018/7/20		73	73		▲0.600	▲0.600	

●2018年7月20日の予定

*6月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.8%	*国庫短期証券(772回)入札 (3ヶ月、43,200億円、7/23発行)	*流動性供給入札 (4,000億円、7/23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