

# Central Daily Market Report

2018年7月20日(金)

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20日 需給速報	2018年7月23日 需給予想	2018年7月24日 当社予想
銀行券	0	500	▲ 1,000
財政	▲ 13,600	1,900	1,000
資金過不足	▲ 13,600	2,400	0
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		1,300	▲ 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		▲ 300	▲ 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
E T F買入	100	100	
国債補充供給	▲ 300	400	300
当預増減	▲ 7,000	2,400	0
当座預金残高	3,878,500	3,880,900	3,880,900
準備預金残高	3,391,500		
積み終了先	3,389,200		
超過準備	3,383,600		
非準備預金先	487,000		
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	99.53%	日数
			22.58%

## ●2018年7月20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。週末要因があったものの取り急ぐ動きは見られず、一巡後は▲0.086~▲0.080%の出会い水準で推移した。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

### <レポ市場>

GC T+0(7/20-7/23)は▲0.110~▲0.095%程度 of 出会い、T/N(7/23-7/24)は▲0.120~▲0.100%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は低水準で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引の▲0.163~▲0.16%での強めの出会いを受け、平均落札利回▲0.1579%、按分落札利回▲0.1523%と前回債からレートが低下する結果となった。セカンダリーでは、▲0.16~▲0.154%出会いと底堅く推移した。この他に、1Y物が▲0.147~▲0.146%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100億円強に対して、発行総額は2,000億円強と発行超であった。卸売・電力業態において大型案件は見られ、やや活況な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

2018/7/20	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	▲ 0.072				-	▲ 0.101	0.030	▲ 0.005	22,697.88	▲ 66.80	112.36-37	112.44-45
T/N			0.000				-	▲ 0.121						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.126						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.131						
3W							-	▲ 0.133						
1M							-	▲ 0.136						
3M							▲ 0.155	▲ 0.141						
6M							▲ 0.149	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.158						
									日付	7/12	7/13	7/17	7/18	7/19
									日銀当預残	3,852,200	3,853,100	3,868,000	3,886,400	3,885,500
									準備預金残	3,429,100	3,390,100	3,394,000	3,404,700	3,400,900
									マネタリーベース	4,944,700	4,946,100	4,960,300	4,977,600	4,977,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.065%	▲ 0.072%	▲ 0.072%	▲ 0.072%
									コール市場残高	118,813	103,278	99,481	91,651	92,686
									うち無担	87,184	74,977	74,508	70,220	70,788
									うちO/N	56,119	45,252	48,513	44,875	44,383
									うち有担	31,629	28,301	24,973	21,431	21,898

## ●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)
国庫短期証券	772	-	43,200	2018/7/23	2018/10/22	141,285.0	36,455.2	100.0380	▲0.1523%	44.7561%	100.0394	▲0.1579%	6,744.0
流動性供給	266	-	4,000	2018/7/23		15,586.0	3,989.00		▲0.0010%	9.1342%		▲0.0030%	

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/7/23	2018/8/6		1,263	1,263				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	19,948	2018/7/20	2018/7/23		322	322		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年7月23日の予定

\*6月の米中古住宅販売

◆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