

Central Daily Market Report

2018年7月23日(月)
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23日 需給速報	2018年7月24日 需給予想	2018年7月25日 当社予想
銀行券	500	▲ 700	▲ 1,000
財政	▲ 1,800	▲ 2,400	7,000
資金過不足	▲ 1,300	▲ 3,100	6,000
金融調節			
	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		10,000	
国債買入		6,000	
CP等買入		▲ 300	▲ 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	▲ 100
E T F買入	100		1,000
国債補完供給	▲ 500	300	500
当預増減	▲ 1,800	13,200	7,000
当座預金残高	3,876,700	3,889,900	3,896,900
準備預金残高	3,388,300		
積み終了先	3,386,300		7月24日以降の残り所要積立額
超過準備	3,386,000		積数 12,400
非準備預金先	488,400		1日平均 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	99.60%	日数 25.81%

●2018年7月23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。先週末と同様に調達意欲は弱く、一巡後も調達側の参加者はほとんど現れず、▲0.08%台で散発的な出合いが見られた程度であった。ターム物は出合い閑散であった。

<レポ市場>

GC T+0(7/23-7/24)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。T/N(7/24-7/25)は、▲0.15~▲0.13%程度での出合い。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。10Y339~351、5Y130~135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、短国買入オペアが10,000億円(前日比+5,000億円)でオファーされた。応募額が3兆円台と多く、目先の不透明感による処分売りから平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差+0.005%と甘めの結果となった。マーケットでは3M物が▲0.15~▲0.145%、1Y物が▲0.143~▲0.14%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、五・十日に当たり、ノンバンク、電気機器、鉄鋼、繊維製品等の業態で比較的多くまとまった額の調達が行われ、償還総額650億円程度に対し、発行総額は3,000億円弱まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/7/23	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	▲ 0.068				-	▲ 0.101	0.080	0.050	22,396.99	▲ 300.89	111.05-07	110.96-97
T/N			0.000				-	▲ 0.127						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	0.230	▲ 0.043				-	▲ 0.125						
2W	▲ 0.050	▲ 0.005	▲ 0.028				-	▲ 0.130						
3W							-	▲ 0.132						
1M							-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.148	▲ 0.139						
6M							▲ 0.138	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.157						
									日付	7/13	7/17	7/18	7/19	7/20
									日銀当預残	3,853,100	3,868,000	3,886,400	3,885,500	3,878,500
									準備預金残	3,390,100	3,394,000	3,404,700	3,400,900	3,391,500
									マネタリーベース	4,946,100	4,960,300	4,977,600	4,977,100	4,970,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.065%	▲ 0.072%	▲ 0.072%	▲ 0.072%	▲ 0.072%
									コール市場残高	103,278	99,481	91,651	92,686	100,330
									うち無担	74,977	74,508	70,220	70,788	71,734
									うちO/N	45,252	48,513	44,875	44,383	44,659
									うち有担	28,301	24,973	21,431	21,898	28,596

●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	10,000	2018/7/24			31,373	10,001	0.005		0.007	83.4
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/7/24			2,716	501	0.025		0.025	92.9
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/7/24			11,041	2,501	0.015		0.015	55.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/7/24			10,344	3,003	0.021		0.023	39.0
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	2,136	2018/7/23	2018/7/24		368	368		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先・即日(午後オファー分))	40,000	2018/7/23	2018/7/24		149	149		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)		2018/7/24			0	0				

※国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.080%。この結果、10年利付国債351回の買入利回りは、0.110%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2018年7月24日の予定

*5月の景気動向指数改訂状況	*40年利付国債入札(4,000億円、7/25発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、8/1借入)
----------------	----------------------------	----------------------------

◆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