

# Central Daily Market Report

2018年7月24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24日 需給速報		2018年7月25日 需給予想		2018年7月26日 当社予想	
銀行券	▲ 600		200		▲ 2,000	
財政	▲ 5,200		4,400		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 5,800		4,600		▲ 4,000	
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						
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		▲ 100		▲ 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	1,000	▲ 200		
ETF買入						
国債補充供給	▲ 700	500		700		
当増減	9,800		6,000		▲ 4,000	
当座預金残高	3,886,500		3,892,500		3,888,500	
準備預金残高	3,398,100					
積み終了先	3,396,300		7月25日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,396,300		積数		10,600	
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	99.66%	日数	29.03%		

## ●2018年7月24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。引き続き調達ニーズが弱い状況に変化はなく、一巡後は▲0.08%近辺の出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物はロール案件中心で散発的に出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(7/24-7/25)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。T/N(7/25-7/26)は、▲0.18~▲0.16%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、5Y130~136、20Y165などにビッドの入りが目立った。

### <短国市場>

現先T/Nは低下した。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、3M物が▲0.15%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、ノンバンクで800億円超の大型案件が実施された他、不動産や化学業態でも、まとまった額の調達が行われ、償還総額600億円程度に対し、発行総額は2,000億円程度と発行超となった。発行残高が順調に積み上がっており、深いマイナスで積極的に購入する動きは一巡していることから、レートは0%近辺に上昇している。

## ●短期金融市場関連指標

2018/7/24	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	▲ 0.070				-	▲ 0.137	0.080	0.000	22,510.48	113.49	111.46-47	111.20-21
T/N			0.000				-	▲ 0.169						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.049				-	▲ 0.155						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.150						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.146						
1M							-	▲ 0.146						
3M							▲ 0.151	▲ 0.141						
6M							▲ 0.134	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.139	▲ 0.155						
									日付	7/17	7/18	7/19	7/20	7/23
									日銀当預残	3,868,000	3,886,400	3,885,500	3,878,500	3,876,700
									準備預金残	3,394,000	3,404,700	3,400,900	3,391,500	3,388,300
									マネタリーベース	4,960,300	4,977,600	4,977,100	4,970,200	4,967,900
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.072%	▲0.072%	▲0.072%	▲0.068%
									コール市場残高	99,481	91,651	92,686	100,330	89,764
									うち無担	74,508	70,220	70,788	71,734	65,759
									うちO/N	48,513	44,875	44,383	44,659	38,214
									うち有担	24,973	21,431	21,898	28,596	24,005

## ●入札結果

名称	回数	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I非価格競争入札(億円)
40年利付国債	11	0.80%	4,000	2018/7/25	2058/3/20	13,193.0	3,995.00		0.8800%	36.6400%			
交付税特会	-	-	10,500	2018/8/1	2019/1/30	212,427.0	10,500.13		0.0000%	4.9430%		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	応募総額(億円・百万ドル)	着札総額(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	平均着札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,039	2018/7/24	2018/7/25		653	653		▲0.600	▲0.601	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	203	2018/7/24	2018/7/25		40	40		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/7/26	2018/8/2	2.42	0	0				

## ●2018年7月25日の予定

\*米国6月の新築一戸建て販売件数

◆本資料は信頼できるとさ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。

◆本資料は何ら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自身でなされよう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選ばれる書面や目録見書をよくお読みください。