Central Daily Market Report

2018年7月25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25日 需給速報		2018年7月26日 需給予想		2018年7月27日 当社予想	
銀行券	100		▲ 1,200		▲ 1,000	
財政	4,600		1,600		2,000	
資金過不足	4,700		400		1,000	
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						
国債買入			6,900			
CP等買入		▲ 100		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000	▲ 200		▲ 100		
ＥＴＦ買入			700			
国債補完供給	▲ 500	700		500		
当預増減	5,600		7,900		1,000	

当座預金残高	3,892,100	3,900,000	3,901,000
準備預金残高	3,403,400		
積み終了先	3,401,400		
超過準備	3,401,400		
非準備預金先	488,700		

7月26日以降の残り所要積立額	
積数	8,600
1日平均	400

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	99.73%	日数 32.26%

●2018年7月25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。調達側から取り急ぐ姿は見られず、一巡後は▲0.08%近辺で散発的な出合いが見られた。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(7/25-7/26)は、▲0.16～▲0.15%程度の出合い。T/N(7/26-7/27)は、▲0.20～▲0.19%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、20Y165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▲0.16～▲0.159%、1Y物が▲0.147～▲0.141%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、機械、卸売、繊維製品等の業態で比較的まとまった額の調達が行われたこともあり、発行総額は1,800億円程度と償還総額1,000億円程度を上回った。発行レートは0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/7/25	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.069				－	▲ 0.161
T/N			0.000				－	▲ 0.200
S/N							－	－
1W	▲ 0.058	▲ 0.055	▲ 0.057				－	▲ 0.181
2W							－	▲ 0.166
3W							－	▲ 0.157
1M			0.040				－	▲ 0.150
3M							▲ 0.159	▲ 0.145
6M							▲ 0.133	▲ 0.150
1Y							▲ 0.144	▲ 0.159

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.065	▲ 0.015	22,614.25	103.77	111.27-28	111.25-27

日付	7/18	7/19	7/20	7/23	7/24
日銀当預残	3,886,400	3,885,500	3,878,500	3,876,700	3,886,500
準備預金残	3,404,700	3,400,900	3,391,500	3,388,300	3,398,100
マネタリーベース	4,977,600	4,977,100	4,970,200	4,967,900	4,978,300
無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.072%	▲0.072%	▲0.068%	▲0.070%
コール市場残高	91,651	92,686	100,330	89,764	87,790
うち無担	70,220	70,788	71,734	65,759	68,750
うちO/N	44,875	44,383	44,659	38,214	40,495
うち有担	21,431	21,898	28,596	24,005	19,040

●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Ｉ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
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,100	2018/7/26			12,095	4,104	▲0.009		▲0.007	59.5
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,800	2018/7/26			4,021	1,803	▲0.019		▲0.014	11.5
国債買入（残存期間25年超）	600	2018/7/26			1,103	601	▲0.024		▲0.011	98.1
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	88,729	2018/7/25	2018/7/26		452	452		▲0.600	▲0.627	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	700	2018/7/25	2018/7/26		3	3		▲0.600	▲0.600	

●2018年7月26日の予定

*6月の企業向けサービス価格指数
*ECB定例理事会（金融政策発表）
*米国6月の耐久財新規受注
*2年利付国債入札
（21,000億円、8/1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論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