

Central Daily Market Report

2018年7月30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30日 需給速報	2018年7月31日 需給予想	2018年8月1日 当社予想			
銀行券	100	▲ 100	1,000			
財政	3,700	15,100	▲ 25,000			
資金過不足	3,800	15,000	▲ 24,000			
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	2,600	▲ 2,900				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			2,500			
国債買入	10,600		16,400			
CP等買入		▲ 200	2,000	▲ 1,400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 600	300		600		
当預増減	13,600		35,100			▲ 24,000
当座預金残高	3,911,500		3,946,600			3,922,600
準備預金残高	3,423,100					
積み終了先	3,422,200				7月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,422,200				積数	4,000
非準備預金先	488,400				1日平均	200
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	99.87%	日数	48.39%		

●2018年7月30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。先週と同様に低調な地合いとなり、一巡後は▲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、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T+0(7/30-7/31)は、▲0.11~▲0.10%程度の出合い。T/N(7/31-8/1)は、▲0.25~▲0.17%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などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは末初に該当し、レートが低下した。アウトライト市場では、短国買入オペアが2,500億円(前回は▲7,500億円)でオファーされた。応札額が5,000億円弱と少なく、平均落札利回較差▲0.009%、按分落札利回較差▲0.025%と強い結果となった。オペア後は、3M物が▲0.21~▲0.20%、1Y物が▲0.15%出合いと強含んだ。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、償還額は非常に少額であったものの、石油・商社等から大型発行が見られたため、発行は2,000億円程に膨らんだ。発行レートは、市場残高の増加の影響もあってか、全体的に目線が若干上昇しており、マイナス圏での決着が減少し、若干のプラス圏での決着に転じる案件が増加した。

●短期金融市場関連指標

2018/7/30	無担(速報)			有担(速報)			短国 先買参考統計値	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				-	▲ 0.113	0.100	0.005	22,544.84	▲ 167.91	110.94-95	111.02-04
T/N			0.000				-	▲ 0.240						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.056	▲ 0.025	▲ 0.051				-	▲ 0.172						
2W							-	▲ 0.160						
3W							-	▲ 0.151						
1M							-	▲ 0.148						
3M	▲ 0.010	0.070	0.010				▲ 0.189	▲ 0.145						
6M							▲ 0.138	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.156	▲ 0.159						
									日付	7/23	7/24	7/25	7/26	7/27
									日銀当預残	3,876,700	3,886,500	3,892,100	3,897,500	3,897,900
									準備預金残	3,388,300	3,398,100	3,403,400	3,404,300	3,411,200
									マネタリーベース	4,967,900	4,978,300	4,983,900	4,990,600	4,991,700
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.070%	▲0.069%	▲0.070%	▲0.071%
									コール市場残高	89,764	87,790	79,036	80,590	82,102
									うち無担	65,759	68,750	63,122	66,281	68,254
									うちO/N	38,214	40,495	34,627	37,886	40,829
									うち有担	24,005	19,040	15,914	14,309	13,848

●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	2,500	2018/7/31			4,988	2,501	▲0.025		▲0.009	11.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,368	2018/7/30	2018/7/31		630	630		▲0.600	▲0.709	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,324	2018/7/30	2018/7/31		1	1		▲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)		2018/7/31			16,403	16,403				

※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、0.005%。この結果、10年利付国債351回の買入利回りは、0.100%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2018年7月31日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*米国FOMC(1日目)
*黒田日銀総裁、定例会見	*米国5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*6月の完全失業率(市場予想：2.3%)	*米国6月の個人所得・消費支出
*6月の有効求人倍率(市場予想：1.6倍)	*米国7月のシカゴPM景況感指数
*6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲0.4%)	*米国7月のCB消費者信頼感指数
*6月の住宅着工統計	*ユーロ圏4-6月期GDP1次速報
*7月の消費動向調査	*ユーロ圏7月のCPI速報値

◆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