

Central Daily Market Report

2018年7月27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27日		2018年7月30日		2018年7月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		200		1,000	
財政	800		1,900		20,100	
資金過不足	0		2,100		21,100	
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						
国債買入			10,600			
CP等買入		▲ 200		▲ 200	2,000	
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						
国債補充供給	▲ 300	900		300		
当預増減	400		12,500		23,100	
当座預金残高	3,897,900		3,910,400		3,933,500	
準備預金残高	3,411,200					
積み終了先	3,410,400				7月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,410,400				積数 4,800	
非準備預金先	486,700				1日平均 300	
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		99.85%		日数 45.16%	

●2018年7月27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・証券業を中心に▲0.086~▲0.050%近辺の調達で始まった。週末であったものの、調達ニーズの弱い地合いに変化は無く、一巡後は▲0.080%近辺で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。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(7/27-7/30)は、▲0.15~▲0.10%程度の出合い。T/N(7/30-7/31)は、▲0.17~▲0.15%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取引において▲0.14%から▲0.157%に買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1531%、按分落札利回▲0.1443%と按分レートが若干流れる結果となった。セカンダリーでは、▲0.165~▲0.16%出合いと強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.145~▲0.144%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は月末発行に当たり、機械、ゴム、不動産、電気・ガス等の多くの業態で大ロットの発行が散見されたものの、発行総額は8,400億円程度と償還総額1兆1,000億円程度を下回った。発行レートは、引続き0%近辺の狭いレンジで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/7/27	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	▲ 0.071				-	▲ 0.129	0.095	0.010	22,712.75	125.88	111.16-17	111.02-04
T/N			0.000				-	▲ 0.166						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.169						
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.032				-	▲ 0.159						
3W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.002				-	▲ 0.150						
1M							-	▲ 0.147						
3M							▲ 0.163	▲ 0.144						
6M							▲ 0.130	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.159						
									日付	7/20	7/23	7/24	7/25	7/26
									日銀当預残	3,878,500	3,876,700	3,886,500	3,892,100	3,897,500
									準備預金残	3,391,500	3,388,300	3,398,100	3,403,400	3,404,300
									マネタリーベース	4,970,200	4,967,900	4,978,300	4,983,900	4,990,600
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.068%	▲0.070%	▲0.069%	▲0.070%
									コール市場残高	100,330	89,764	87,790	79,036	80,590
									うち無担	71,734	65,759	68,750	63,122	66,281
									うちO/N	44,659	38,214	40,495	34,627	37,886
									うち有担	28,596	24,005	19,040	15,914	14,309

●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)	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	773	-	42,500	2018/7/30	2018/10/29	157,120.0	35,872.6	100.0360	▲0.1443%	78.0833%	100.0382	▲0.1531%	6,627.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/8/7	2019/2/6	214,176.0	10,500.08		0.0000%	4.9026%		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	2018/7/30	2018/8/13		2,554	2,554				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/7/30			8,399	2,504	0.008		0.009	75.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/7/30			5,786	3,002	0.005		0.007	98.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/7/30			13,316	4,103	0.013		0.016	16.1
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	30,298	2018/7/27	2018/7/30		272	272		▲0.600	▲0.611	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)		2018/7/30			940	940				

※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、0.015%。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30日の予定

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、31日まで)
- *6月の商業動態統計速報

◆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