

# Central Daily Market Report

2018年7月12日(木)  
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12日		2018年7月13日		2018年7月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 600			1,000
財政	▲ 21,800		100			7,000
資金過不足	▲ 22,900		▲ 500			8,000
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						▲ 2,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,700					
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
E T F買入	800		600			
国債補完供給	▲ 500	200		500		
当預増減	▲ 12,900		500			5,600
当座預金残高	3,852,200		3,852,700			3,858,300
準備預金残高	3,429,100					
積み終了先	3,429,000				7月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,429,000				積数	300
非準備預金先	423,100				1日平均	100
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,031,300
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	90.00%		

## ●2018年7月12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~▲0.035%での調達で始まった。明日は実質的な積み最終日かつ週末を跨ぐ取引にあたるため、前倒しでの調達に動いた中堅行を中心にビッドが増加し、一部取り上がる先も見られた。一巡後は調整から▲0.086~▲0.050%程度で散發的な出合いが見られていた。ターム物に関しては来積み期スタートのショートターム物で▲0.060%程度の出合いが見られていた。

### <レポ市場>

GC T+0(7/12-7/13)は▲0.090~▲0.085%程度の出合い、T/N(7/13-7/17)は▲0.095~▲0.090%程度で出合いとなった。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。個別銘柄では10Y336~351、5Y130~136、40Y11などにビッドの出入りが目立った。

### <短国市場>

現先T/Nは、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、3M物が▲0.15~▲0.149%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は、石油・小売・卸売・ゴム製品など複数業態からまとまった発行が見られ、償還総額2,600億円程度に対して、発行総額は4,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは引続き横ばいで推移した。本日2,000億円で実施されたCP等買入オペは、平均落札レート▲0.001%・按分落札レート▲0.003%となり、前回比で平均落札レートが僅かに低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/7/12	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	▲ 0.064				-	▲ 0.091	0.035	0.000	22,187.96	255.75	111.97-99	112.33-34
T/N	▲ 0.045	0.000	▲ 0.038				-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.045	▲ 0.052				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.040	0.160	0.008				-	▲ 0.109						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.147	▲ 0.130						
6M							▲ 0.147	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.157						
									日付	7/5	7/6	7/9	7/10	7/11
									日銀当預残	3,878,000	3,871,600	3,884,300	3,887,500	3,865,100
									準備預金残	3,382,700	3,387,000	3,421,900	3,434,500	3,417,200
									マネタリーベース	4,970,800	4,964,500	4,976,100	4,979,200	4,956,500
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.069%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.068%
									コール市場残高	105,047	105,275	110,479	108,237	114,258
									うち無担	80,846	74,870	77,684	80,428	82,935
									うちO/N	50,731	44,955	47,869	49,713	51,920
									うち有担	24,201	30,405	32,795	27,809	31,323

## ●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)
20年利付国債	165	0.50%	10,000	2018/7/13	2038/6/20	36,563.0	8,059.00	100.1000	0.4940%	63.8373%	100.1300	0.4920%	1,932.0

## ●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)	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
CP等買入	2,000	2018/7/18			6,295	1,990	▲0.003		▲0.001	26.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	131,214	2018/7/12	2018/7/13		458	458		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/7/12	2018/7/13		27	27		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年7月13日の予定

*米国7月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(770回)入札(3ヶ月、42,500億円、7/17発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、7/24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