

# Central Daily Market Report

2018年7月13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13日		2018年7月17日		2018年7月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		800		1,000	
財政	700		4,700		2,000	
資金過不足	200		5,500		3,000	
<b>金融調節</b>						
	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			2,900	▲ 2,400		
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		▲ 700	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				▲ 100		
E T F買入	600		600			
国債補完供給	▲ 300	500		300		
当預増減	900		13,000		5,000	
当座預金残高	3,853,100		3,866,100		3,871,100	
準備預金残高	3,391,700					
積み終了先	3,391,700				7月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,391,600				積数 593.100	
非準備預金先	461,400				1日平均 19.800	
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 81.05%		日数		3.23%	

## ●2018年7月13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▲0.080~▲0.040%での調達で始まった。実質的な積み最終日にあたるものの、出会い水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は調整から▲0.075~▲0.045%程度で散発的な出会いが見られていた。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(7/13-7/17)は▲0.090~▲0.085%程度の出合い、T/N(7/17-7/18)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、▲0.15~▲0.145%での出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1455%、按分落札利回▲0.1398%と強めの結果となった。セカンダリーにおいても▲0.16~▲0.148%での強めの出合いが見られた。マーケットでは、6M物が▲0.15~▲0.147%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、卸売業態から大型の発行が見られ、償還総額500億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と発行超のマーケットとなった。発行レートは引続き横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/7/13	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.065				-	▲ 0.092	0.035	0.000	22,597.35	409.39	112.66-67	112.78-79
T/N			0.000				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.020	▲ 0.051				-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.050	▲ 0.045	▲ 0.047				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.117						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.149	▲ 0.131						
6M							▲ 0.147	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.157						
									日付	7/6	7/9	7/10	7/11	7/12
									日銀当預残	3,871,600	3,884,300	3,887,500	3,865,100	3,852,200
									準備預金残	3,387,000	3,421,900	3,434,500	3,417,200	3,429,100
									マネタリーベース	4,964,500	4,976,100	4,979,200	4,956,500	4,944,700
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.068%	▲0.064%
									コール市場残高	105,275	110,479	108,237	114,258	118,813
									うち無担	74,870	77,684	80,428	82,935	87,184
									うちO/N	44,955	47,869	49,713	51,920	56,119
									うち有担	30,405	32,795	27,809	31,323	31,629

## ●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	770	-	42,500	2018/7/17	2018/10/15	154,172.0	34,513.5	100.0345	▲0.1398%	11.8144%	100.0359	▲0.1455%	7,986.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/7/24	2019/1/24	231,396.0	10,500.03		0.0000%	4.5378%		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	2018/7/17	2018/7/30		2,853	2,853				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/7/17			15,087	4,106	0.002		0.003	21.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/7/17			6,355	1,906	0.002		0.002	89.2
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/7/17			2,966	702	▲0.001		0.001	65.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	36,450	2018/7/13	2018/7/17		271	271		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2018/7/13	2018/7/17		32	32		▲0.600	▲0.600	
種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)					
被災地金融支援オペ	第87回	2018/7/20	2019/7/19	0	1,105					
被災地金融支援オペ(熊本)	第26回	2018/7/20	2019/7/19	0	0					

## ●2018年7月16日の予定

*海の日	*米国5月の企業在庫	*米国6月の小売売上高
------	------------	-------------

## ●2018年7月17日の予定

*5月の石油等消費動態統計	*6月の米鉱工業生産・設備稼働率
---------------	------------------

◆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