

Central Daily Market Report

2018年8月1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8月1日		2018年8月2日		2018年8月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 1,000		0	
財政	▲ 30,600		▲ 65,500		▲ 19,000	
資金過不足	▲ 30,200		▲ 66,500		▲ 19,000	
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			6,100			
CP等買入						
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	▲ 11,200	13,800		11,200		
当預増減	▲ 27,600		▲ 49,200		▲ 19,000	
当座預金残高	3,909,500		3,860,300		3,841,300	
準備預金残高	3,417,100					
積み終了先	3,416,700		8月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,416,400		積数		2,400	
非準備預金先	492,400		1日平均		200	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,127,300	
準備預金進捗率	実績		99.92%		日数	
					54.84%	

●2018年8月1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。積み期間後半に入ったことでビッドサイドの参加者がやや増加し、オファーの出し残りはあまり見られなかった。一巡後は▲0.086~▲0.08%のレンジで出合いが散見された。ターム物は、1~2W物のショートタームを中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(8/1-8/2)は、▲0.11~▲0.09%程度の出合い。T/N(8/2-8/3)は、▲0.125~▲0.10%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は上昇した。アウトライト市場は、様子見姿勢が強く、全般的に閑散で特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、ノンバンクのまとまった発行が実施されたものの、2,500億円程度の償還に対して、2,000億円強の発行が見られた程度にとどまった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/8/1	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				-	▲ 0.101	0.124	0.078	22,746.70	192.98	111.82-84	112.11-12
T/N			0.000				-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.031				-	▲ 0.107						
2W	▲ 0.058	▲ 0.040	▲ 0.051				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.116						
1M	▲ 0.040	0.030	▲ 0.019				-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.183	▲ 0.134						
6M							▲ 0.134	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.155						
									日付	7/25	7/26	7/27	7/30	7/31
									日銀当預残	3,892,100	3,897,500	3,897,900	3,911,500	3,937,100
									準備預金残	3,403,400	3,404,300	3,411,200	3,423,100	3,444,100
									マネタリーベース	4,983,900	4,990,600	4,991,700	5,005,200	5,030,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.069%	▲ 0.070%	▲ 0.071%	▲ 0.068%	▲ 0.065%
									コール市場残高	79,036	80,590	82,102	75,678	62,649
									うち無担	63,122	66,281	68,254	63,396	53,458
									うちO/N	34,627	37,886	40,829	36,071	28,453
									うち有担	15,914	14,309	13,848	12,282	9,191

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/8/2			3,154	502	0.026		0.032	30.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/8/2			9,450	2,508	0.022		0.023	64.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/8/2			9,046	3,003	0.028		0.031	66.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	72,883	2018/8/1	2018/8/2		11,033	11,033		▲ 0.600	▲ 1.438	

●2018年8月2日の予定

*雨宮日銀副総裁、京都府金融経済懇談会にて講演	*英中銀MPC結果発表	*10年利付国債入札(22,000億円、8/3発行)
*前月実績/当月見込み財政資金対民間収支	*米国6月の製造業新規受注・出荷・在庫	
*7月のマネタリーベース		

◆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