

# Central Daily Market Report

2018年8月2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8月2日		2018年8月3日		2018年8月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 500			2,000
財政	▲ 65,700		▲ 23,500			2,000
資金過不足	▲ 66,700		▲ 24,000			4,000
<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						▲ 1,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,100		4,100			
CP等買入				▲ 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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 10,800	11,200		10,800		
当預増減	▲ 60,200		▲ 9,200			2,700
当座預金残高	3,849,300		3,840,100			3,842,800
準備預金残高	3,373,500					
積み終了先	3,373,200				8月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,373,200				積数	2,100
非準備預金先	475,800				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	99.93%	日数	58.06%		

## ●2018年8月2日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は▲0.085%の寄り付き後、邦銀・証券業態を中心に▲0.086~▲0.040%の出合い。税揚げ日に当たり、資金調達サイドの参加者は戻り基調でビッド残りになる場面も見られた。一巡後は調整から▲0.080~▲0.055%の出合いが見られた。ターム物はロール案件中心にショートターム物の引き合いが見られた程度であった。

### <レポ市場>

GC T+0(8/2-8/3)は、▲0.11~▲0.095%程度の出合い。T/N(8/3-8/6)は、▲0.105~▲0.095%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。アウトライ市場は、引き続き様子見姿勢が強く、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、1,300億円程度の償還に対し、2,200億円強の発行であった。電機・商社業態からは大型発行案件が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/8/2	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	▲ 0.072				-	▲ 0.103	0.115	▲ 0.009	22,512.53	▲ 234.17	111.63-64	111.60-61
T/N			0.000				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.056	▲ 0.050	▲ 0.054				-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.055	▲ 0.053	▲ 0.054				-	▲ 0.108						
3W			0.000				-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.171	▲ 0.131						
6M							▲ 0.130	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.154						
									日付	7/26	7/27	7/30	7/31	8/1
									日銀当預残	3,897,500	3,897,900	3,911,500	3,937,100	3,909,500
									準備預金残	3,404,300	3,411,200	3,423,100	3,444,100	3,417,100
									マネタリーベース	4,990,600	4,991,700	5,005,200	5,030,900	5,002,900
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.071%	▲0.068%	▲0.065%	▲0.071%
									コール市場残高	80,590	82,102	75,678	62,649	87,668
									うち無担	66,281	68,254	63,396	53,458	65,515
									うちO/N	37,886	40,829	36,071	28,453	37,560
									うち有担	14,309	13,848	12,282	9,191	22,153

## ●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)
10年利付国債	351	0.10%	22,000	2018/8/3	2028/6/20	77,698.0	18,613.00	99.6200	0.1380%	48.9994%	99.7400	0.1260%	3,378.0

## ●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5年起10年以下)	4,000	2018/8/3			12,710	4,003	▲0.024		▲0.019	91.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	64,823	2018/8/2	2018/8/3		10,677	10,677		▲0.600	▲1.485	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	15,501	2018/8/2	2018/8/3		3	3		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年8月3日の予定

- \*日銀金融政策決定会合議事要旨(6月14・15日分)
- \*8月の日銀当座預金増減要因見込み
- \*米国6月の貿易収支
- \*米国7月の雇用統計
- \*米国7月のISM非製造業景況指数
- \*国庫短期証券(774回)入札(3ヶ月、42,800億円、8/6発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、8/14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