

Central Daily Market Report

2018年8月3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8月3日 需給速報	2018年8月6日 需給予想	2018年8月7日 当社予想
銀行券	▲ 300	900	1,000
財政	▲ 23,700	100	1,000
資金過不足	▲ 24,000	1,000	2,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		1,300	▲ 1,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	4,100	6,400	
CP等買入		▲ 100	▲ 200
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			
国債補完供給	▲ 2,500	10,800	2,500
当預増減	▲ 11,700	9,600	2,000
当座預金残高	3,837,600	3,847,200	3,849,200
準備預金残高	3,362,000		
積み終了先	3,361,800		
超過準備	3,361,800		
非準備預金先	475,600		
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	99.95%	日数
			67.74%

●2018年8月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担コールO/N物は横ばいの動き。▲0.085%の寄り付き後、邦銀・証券業態を中心に▲0.085~▲0.055%の出合いが見られた。一巡後は▲0.086~▲0.080%で散発的に調整の出合いが見られた程度であった。ターム物はショートタームで▲0.045%程度の出合い。

<レポ市場>

GC T+0(8/3-8/6)は、▲0.105~▲0.09%程度の出合い。T/N(8/6-8/7)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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.145%から▲0.17%に買い進まれる展開となり、平均落札利回▲0.1587%、按分落札利回▲0.1423%と事前予想よりも強めの結果となった。セカンダリーでは、▲0.172~▲0.155%出合いと強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.155%で少額出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、ノンバンクがまとまった発行を実施したが、償還850億円程度に対し、発行も750億円程度と、案件も少なく閑散であった。発行レートに目立った変動はなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/8/3	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				-	▲ 0.098	0.105	▲ 0.010	22,525.18	12.65	111.70-71	111.85-88
T/N	▲ 0.020	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.104						
2W							-	▲ 0.109						
3W			0.000				-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.170	▲ 0.130						
6M							▲ 0.135	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.154						
									日付	7/27	7/30	7/31	8/1	8/2
									日銀当預残	3,897,900	3,911,500	3,937,100	3,909,500	3,849,300
									準備預金残	3,411,200	3,423,100	3,444,100	3,417,100	3,373,500
									マネタリーベース	4,991,700	5,005,200	5,030,900	5,002,900	4,943,800
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.068%	▲0.065%	▲0.071%	▲0.072%
									コール市場残高	82,102	75,678	62,649	87,668	98,639
									うち無担	68,254	63,396	53,458	65,515	76,216
									うちO/N	40,829	36,071	28,453	37,560	47,361
									うち有担	13,848	12,282	9,191	22,153	22,423

●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	774	-	42,800	2018/8/6	2018/11/5	162,801.0	36,151.9	100.0355	▲0.1423%	81.6257%	100.0396	▲0.1587%	6,648.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/8/14	2019/2/13	218,809.0	10,500.15		0.0000%	4.8252%		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	2018/8/6	2018/8/20		1,251	1,251				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2018/8/6			10,883	4,004	▲0.008		▲0.005	89.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/8/6			3,708	1,801	0.009		0.014	30.0
国債買入(残存期間25年超)	600	2018/8/6			1,856	604	0.020		0.021	67.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	82,191	2018/8/3	2018/8/6		2,444	2,444		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	639	2018/8/3	2018/8/6		32	32		▲0.600	▲0.600	

●2018年8月6日の予定

*特にありません。

◆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