

# Central Daily Market Report

2018年8月6日(月)

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6日		2018年8月7日		2018年8月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		200		1,000	
財政	2,000		200		▲ 4,000	
資金過不足	2,900		400		▲ 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	1,300	▲ 1,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			2,500			
国債買入	6,400					
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		▲ 100				
E T F買入						
国債補完供給	▲ 2,300	2,500		2,300		
当預増減	9,200		5,100		▲ 3,000	
当座預金残高	3,846,800		3,851,900		3,848,900	
準備預金残高	3,366,100					
積み終了先	3,365,900					8月7日以降の残り所要積立額
超過準備	3,365,900					積数 1,300
非準備預金先	480,700					1日平均 100
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	99.96%	日数	70.97%		

## ●2018年8月6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物は先週末に続きこじっかりとした展開となった。▲0.085%で寄り付き後は、邦銀・証券業態を中心に▲0.086~▲0.040%の出合いが見られた。一巡後は資金調達希望が残るものの、その後は特段出合いは見られなかった。ターム物はショートタームで▲0.030%の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(8/6-8/7)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。T/N(8/7-8/8)は、▲0.105~▲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は横ばいで推移した。アウトライト市場では、短国買入オペアが2,500億円(前回と同額)でオファーされた。応札額が10,681億円と多く、平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差±0.000%と小甘い結果となった。マーケットでは3M物が▲0.172~▲0.17%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移。発行市場は、案件少なく閑散であった(償還1,000億円程度)。

## ●短期金融市場関連指標

2018/8/6	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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				-	▲ 0.097	0.100	▲ 0.005	22,507.32	▲ 17.86	111.22-24	111.26-27
T/N			0.000				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.033				-	▲ 0.105						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.107						
3W			0.000				-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.170	▲ 0.130						
6M							▲ 0.133	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.154						
									日付	7/30	7/31	8/1	8/2	8/3
									日銀当預残	3,911,500	3,937,100	3,909,500	3,849,300	3,837,600
									準備預金残	3,423,100	3,444,100	3,417,100	3,373,500	3,362,100
									マネタリーベース	5,005,200	5,030,900	5,002,900	4,943,800	4,932,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.068%	▲ 0.065%	▲ 0.071%	▲ 0.072%	▲ 0.071%
									コール市場残高	75,678	62,649	87,668	98,639	99,896
									うち無担	63,396	53,458	65,515	76,216	72,826
									うちO/N	36,071	28,453	37,560	47,361	43,911
									うち有担	12,282	9,191	22,153	22,423	27,070

## ●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
国庫短期証券買入	2,500	2018/8/7			10,681	2,500	0.000		0.002	56.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	114,480	2018/8/6	2018/8/7		2,237	2,237		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,935	2018/8/6	2018/8/7		30	30		▲ 0.600	▲ 0.600	

## ●2018年8月7日の予定

*6月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比▲1.6%)	*米国6月の消費者信用残高	*10年物価連動国債入札 (4,000億円、8/8発行)
*6月の毎月勤労統計調査速報		
*6月の景気動向指数速報		
*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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