

Central Daily Market Report

2018年8月7日(火)

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7日		2018年8月8日		2018年8月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		300		0	
財政	2,900		▲ 4,200		▲ 6,000	
資金過不足	3,100		▲ 3,900		▲ 6,000	
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	2,500					
国債買入						
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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 2,600	2,300		2,600		
当預増減	5,200		▲ 1,500		▲ 6,000	
当座預金残高	3,852,000		3,850,500		3,844,500	
準備預金残高	3,383,400					
積み終了先	3,383,300				8月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,383,300				積数	
非準備預金先	468,600				1日平均	
					100	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,136,200	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	74.19%		

●2018年8月7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物は強含み。▲0.080%で寄り付き後は、邦銀・証券業態を中心に▲0.086~▲0.030%の出合いが見られた。一巡後も▲0.070~▲0.040%が出合うなど、取り上がる動きが見られた。午後は▲0.055%程度で調整の出合い。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(8/7-8/8)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。T/N(8/8-8/9)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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.168%で出合った程度であった。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、商社、ノンバンクから大型案件が見られ、発行・償還ともに2,000億円程度であった。本日はCP等買入オペアが2,000億円オファーされた。結果は按分落札レート▲0.001%、平均落札レート▲0.001%と、按分レートは前回(按分▲0.001%、平均0.003%)と同水準であった。

●短期金融市場関連指標

2018/8/7	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	▲ 0.066				-	▲ 0.097	0.105	0.005	22,662.74	155.42	111.33-34	111.35-36
T/N			0.000				-	▲ 0.104						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.037				-	▲ 0.107						
2W							-	▲ 0.108						
3W			0.000				-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.170	▲ 0.131						
6M							▲ 0.132	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.154						
									日付	7/31	8/1	8/2	8/3	8/6
									日銀当預残	3,937,100	3,909,500	3,849,300	3,837,600	3,846,800
									準備預金残	3,444,100	3,417,100	3,373,500	3,362,100	3,366,100
									マネタリーベース	5,030,900	5,002,900	4,943,800	4,932,300	4,940,600
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.071%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.071%
									コール市場残高	62,649	87,668	98,639	99,896	99,560
									うち無担	53,458	65,515	76,216	72,826	72,742
									うちO/N	28,453	37,560	47,361	43,911	43,677
									うち有担	9,191	22,153	22,423	27,070	26,818

●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)
物価連動10年	23	0.10%	4,000	2018/8/8	2028/3/10	12,475.0	3,996.00	104.0500	▲0.3090%	6.3636%			

●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
CP等買入	2,000	2018/8/10			6,216	1,965	▲0.001		▲0.001	43.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	63,303	2018/8/7	2018/8/8		2,540	2,540		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/8/9	2018/8/16	2.41	1	1				

●2018年8月8日の予定

*決定会合における主な意見(7月30・31日分)
*6月の国際収支
*6月の特定サービス産業動態統計速報
*7月の景気ウォッチャー調査

*エネルギー対策借入
(6,000億円、8/20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