

Central Daily Market Report

2018年8月8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8日 需給速報	2018年8月9日 需給予想	2018年8月10日 当社予想
銀行券	300	▲ 500	▲ 1,000
財政	▲ 7,100	▲ 2,300	▲ 12,000
資金過不足	▲ 6,800	▲ 2,800	▲ 13,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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		9,800	
CP等買入	▲ 200	▲ 200	2,000
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	▲ 1,500	2,600	1,500
当預増減	▲ 5,900	8,300	▲ 11,000
当座預金残高	3,846,100	3,854,400	3,843,400
準備預金残高	3,373,900		
積み終了先	3,373,700		
超過準備	3,373,700		
非準備預金先	472,200		
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	99.97%	日数
			77.42%

●2018年8月8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。▲0.070%で寄り付いた後、邦銀・証券業態を中心に▲0.080~▲0.030%が出合いとなった。一巡後は▲0.045%が小額出合い。午後は調整の▲0.086%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▲0.035%程度で出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(8/8-9)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。T/N(8/9-10)は、▲0.12~▲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は低水準で推移した。アウトライト市場は、入札を控えた処分売りから軟調な展開で、3M物が▲0.165~▲0.15%の出合いが見られるなどレートが上昇した。

<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、10日発行の応当日であることに加え、鉄鋼、建設、不動産、ノンバンクから大型案件も見られ、発行量は4,000億円程度まで膨らんだ(償還3,000億円程度)。発行レートは概ね0%近辺での決着であった。

●短期金融市場関連指標

2018/8/8	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	現買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.060					-	▲ 0.096	0.105	0.000	22,644.31	▲ 18.43	111.34-35	110.94-96
T/N			0.000					-	▲ 0.111						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.024					-	▲ 0.110						
2W	▲ 0.028	▲ 0.025	▲ 0.027					-	▲ 0.112						
3W								-	▲ 0.114						
1M			0.000					-	▲ 0.120						
3M								▲ 0.153	▲ 0.132						
6M								▲ 0.131	▲ 0.146						
1Y								▲ 0.133	▲ 0.154						
										日付	8/1	8/2	8/3	8/6	8/7
										日銀当預残	3,909,500	3,849,300	3,837,600	3,846,800	3,852,000
										準備預金残	3,417,100	3,373,500	3,362,100	3,366,100	3,383,400
										マネタリーベース	5,002,900	4,943,800	4,932,300	4,940,600	4,945,600
										無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.066%
										コール市場残高	87,668	98,639	99,896	99,560	95,440
										うち無担	65,515	76,216	72,826	72,742	71,689
										うちO/N	37,560	47,361	43,911	43,677	44,274
										うち有担	22,153	22,423	27,070	26,818	23,751

●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)
エネルギー対策	-	-	6,000	2018/8/20	2019/8/20	96,062.0	5,999.83		0.0000%	6.2459%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/8/9			9,398	2,506	0.003		0.003	80.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/8/9			8,233	3,006	0.002		0.003	42.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2018/8/9			12,815	4,003	▲0.003		0.000	6.9
国債買入(物価連動債)	250	2018/8/9			1,359	251	▲0.060		▲0.092	54.9
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	41,897	2018/8/8	2018/8/9		1,506	1,506		▲0.600	▲0.600	

●2018年8月9日の予定

*6月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.3%)	*米国6月の卸売売上高 *米国7月の生産者物価指数	*国庫短期証券(775回)入札 (6ヶ月、23,000億円、8/10発行) *30年利付国債入札 (7,000億円、8/10発行)
---	------------------------------	--

◆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