

Central Daily Market Report

2018年8月9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9日		2018年8月10日		2018年8月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 400		1,000	
財政	▲ 2,000		▲ 10,000		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 2,400		▲ 10,400		▲ 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						▲ 2,600
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	2,000	▲ 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	▲ 1,100	1,500		1,100		
当預増減	7,600		▲ 7,600		▲ 8,600	
当座預金残高	3,853,700		3,846,100		3,837,500	
準備預金残高	3,377,000					
積み終了先	3,376,900		8月10日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,376,900		積数		900	
非準備預金先	476,700		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	99.97%	日数	80.65%		

●2018年8月9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物は昨日比で強含みの展開。▲0.065%テイクンで寄り付いた後は、邦銀・証券業態を中心に▲0.070~▲0.030%の出会いとなった。一巡後も▲0.075~▲0.025%で調整の出会いが見られるなど堅調に推移した。ターム物はロール案件の引き合いが見られた程度であった。

<レポ市場>

GC T+0(8/9-8/10)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。T/N(8/10-8/13)は、▲0.11~▲0.09%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、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.165~▲0.16%での強めの出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1549%、按分落札利回▲0.1451%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、▲0.165~▲0.159%の出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.154~▲0.148%で出合った。

<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、案件少なく閑散であった(償還100億円程度)。

●短期金融市場関連指標

2018/8/9	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.096	0.110	0.005	22,598.39	▲ 45.92	110.89-91	111.04-05
T/N			0.000				-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.029	▲ 0.030				-	▲ 0.110						
2W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.114						
1M	0.000	0.380	0.035				-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.152	▲ 0.131						
6M							▲ 0.159	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.155						
									日付	8/2	8/3	8/6	8/7	8/8
									日銀当預残	3,849,300	3,837,600	3,846,800	3,852,000	3,846,100
									準備預金残	3,373,500	3,362,100	3,366,100	3,383,400	3,373,900
									マネタリーベース	4,943,800	4,932,300	4,940,600	4,945,600	4,939,400
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.066%	▲0.060%
									コール市場残高	98,639	99,896	99,560	95,440	108,800
									うち無担	76,216	72,826	72,742	71,689	83,815
									うちO/N	47,361	43,911	43,677	44,274	55,520
									うち有担	22,423	27,070	26,818	23,751	24,985

●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	775	-	23,000	2018/8/10	2019/2/12	99,562.0	19,434.6	100.0740	▲0.1451%	20.8286%	100.0790	▲0.1549%	3,565.0
30年利付国債	59	0.70%	7,000	2018/8/10	2048/6/20	27,437.0	5,864.00	96.3500	0.8530%	73.4502%	96.4100	0.8500%	1,128.0

●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	申込総額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	33,721	2018/8/9	2018/8/10		1,098	1,098		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	13,257	2018/8/9	2018/8/10		2	2		▲0.600	▲0.600	

●2018年8月10日の予定

*4-6月期のGDP1次速報 (市場予想：前期比年率+1.4%)	*米国7月の財政収支	*国庫短期証券(776回)入札 (3ヶ月、43,000億円、8/13発行)
*6月の第3次産業活動動指数	*米国7月の消費者物価指数	*交付税特別会計借入 (10,500億円、8/22借入)
*7月の企業物価指数	*英国4-6月期のGDP速報値	

◆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