

Central Daily Market Report

2018年8月10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10日		2018年8月13日		2018年8月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		200		0	
財政	▲ 10,000		▲ 8,300		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 10,300		▲ 8,100		▲ 7,000	
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			2,200	▲ 2,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,400			
CP等買入	2,000	▲ 200		▲ 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	▲ 1,900	1,100		1,900		
当預増減	▲ 9,400		1,600		▲ 7,000	
当座預金残高	3,844,300		3,845,900		3,838,900	
準備預金残高	3,377,500					
積み終了先	3,377,300		8月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,377,300		積数		400	
非準備預金先	466,800		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		99.99%		日数	
					90.32%	

●2018年8月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日までと同様、朝方から積極的にテイクンされる展開となった。立ち上がりは地銀・証券・信託業態の調達を中心に▲0.07~▲0.02%近辺の幅広いレンジで出合いが見られた。一巡後はビッドサイドが取り下がり、▲0.08~▲0.07%近辺で取引が行われた。ターム物は閑散気味でロール案件の引き合いが中心であった。本日の共通担保資金供給オペは、2W物8,000億円のオファーに対し、応札額2,154億円(期落額2,554億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(8/10-8/13)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。T/N(8/13-8/14)は、▲0.10~▲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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.165%から一時▲0.18%まで買い進まれる展開となったこともあり、平均落札利回▲0.1635%、按分落札利回▲0.1543%と強めの結果となった。セカンダリーでは、▲0.165~▲0.155%出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、6M物が▲0.174~▲0.165%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、案件こそ少なかったものの、石油、ゴムなどから大型案件が見られたことから、500億円程度の償還に対して発行は1,300億円程度であった。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

2018/8/10	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.096	0.100	▲ 0.010	22,298.08	▲ 300.31	111.09-11	110.66-67
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.108						
2W							-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.114						
1M			0.050				-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.157	▲ 0.131						
6M							▲ 0.169	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.155						
									日付	8/3	8/6	8/7	8/8	8/9
									日銀当預残	3,837,600	3,846,800	3,852,000	3,846,100	3,853,700
									準備預金残	3,362,100	3,366,100	3,383,400	3,373,900	3,377,000
									マネタリーベース	4,932,300	4,940,600	4,945,600	4,939,400	4,947,400
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.071%	▲0.066%	▲0.060%	▲0.055%
									コール市場残高	99,896	99,560	95,440	108,800	107,657
									うち無担	72,826	72,742	71,689	83,815	86,514
									うちO/N	43,911	43,677	44,274	55,520	60,769
									うち有担	27,070	26,818	23,751	24,985	21,143

●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	776	-	43,000	2018/8/13	2018/11/12	128,442.0	36,324.4	100.0385	▲0.1543%	72.1178%	100.0408	▲0.1635%	6,675.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/8/22	2019/2/19	208,904.0	10,500.05		0.0000%	5.0263%		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	2018/8/13	2018/8/27		2,154	2,154				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/8/13			8,211	2,503	0.000		0.001	84.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/8/13			9,699	3,009	▲0.004		▲0.004	86.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/8/13			6,983	1,815	▲0.012		▲0.011	98.0
国債買入(残存期間25年超)	600	2018/8/13			1,937	606	▲0.019		▲0.018	47.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	97,441	2018/8/10	2018/8/13		1,797	1,797		▲0.600	▲0.751	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	19,960	2018/8/10	2018/8/13		70	70		▲0.600	▲0.600	

●2018年8月13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