

# Central Daily Market Report

2018年8月24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24日		2018年8月27日		2018年8月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		500			0
財政	▲ 4,800		1,500			1,000
資金過不足	▲ 4,900		2,000			1,000
<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			2,200	▲ 2,200		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,600			
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	900	▲ 900				
社債等買入		▲ 100	800			
E T F買入	700					
国債補充供給	▲ 400	400		400		
当預増減	▲ 4,700		12,500			1,000
当座預金残高	3,916,800		3,929,300			3,930,300
準備預金残高	3,423,100					
積み終了先	3,422,400				8月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,422,300				積数	8,700
非準備預金先	493,700				1日平均	400
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額						3,120,700
準備預金進捗率	実績	99.72%	日数	35.48%		

## ●2018年8月24日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀業態から▲0.06~▲0.04%、都銀・信託・証券業態から▲0.08~▲0.06%近辺の調達希望で始まり、朝方の出合い水準は▲0.075~▲0.04%のレンジが中心となった。一巡後はややレートを切り下げ、▲0.086~▲0.065%近辺で取引が行われた。ターム物は1W物のショートタームを中心に▲0.04%近辺の引き合いが散見された。本日の共通担保資金供給オペは2W物が8,000億円オファーされ、応札額2,164億円(期落ち額2,154億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T+0(8/24-8/27)は▲0.15~▲0.10%程度、T/N(8/27-8/28)は▲0.155~▲0.11%程度で出合いが見られた。T/Nは短国3ヶ月物の発行日だったが、影響は限定的だった。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。個別銘柄では10Y340~351、5Y131~135などにビットが目立った。

### <短国市場>

現先レートT/Nは横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において一時▲0.17%での出合いが見られたものの、その後は▲0.154%まで売られる展開となった。入札結果もWI取引を反映し、平均落札利回▲0.1551%、按分落札利回▲0.1463%と按分レートが流れる結果となった。セカンダリーでは、全般的に引けにかけて買い進まれた。3M物が▲0.154~▲0.15%、1Y物が▲0.17~▲0.16%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,100億円強に対して、発行総額は1,600億円強と発行超であった。一部の卸売業態において大型案件が見られたものの、案件数は膨らまず落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/8/24	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	▲ 0.053				-	▲ 0.125	0.095	0.005	22,601.77	190.95	111.36-37	111.39-41
T/N			0.000				-	▲ 0.140						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.037	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.146						
2W			0.020				-	▲ 0.141						
3W							-	▲ 0.140						
1M							-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.152	▲ 0.141						
6M							▲ 0.164	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.157						
									日付	8/17	8/20	8/21	8/22	8/23
									日銀当預残	3,923,200	3,926,600	3,933,400	3,916,400	3,921,500
									準備預金残	3,439,900	3,436,000	3,440,100	3,423,500	3,427,200
									マネタリーベース	5,017,600	5,020,500	5,027,000	5,009,800	5,016,300
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.066%	▲0.063%	▲0.061%	▲0.055%
									コール市場残高	91,035	96,459	94,604	94,391	91,517
									うち無担	74,795	69,727	72,136	75,387	75,382
									うちO/N	48,400	42,822	45,061	48,102	47,097
									うち有担	16,240	26,732	22,468	19,004	16,135

## ●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	779	-	42,500	2018/8/27	2018/11/26	143,856.0	34,776.6	100.0365	▲0.1463%	1.6522%	100.0387	▲0.1551%	7,723.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/9/4	2019/3/6	217,737.0	10,500.17		0.0000%	4.8491%		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	2018/8/27	2018/9/10		2,164	2,164				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/8/27			9,284	2,503	0.005		0.006	8.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/8/27			8,549	3,006	0.006		0.006	93.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2018/8/27			11,682	4,008	0.006		0.007	29.9
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	60,000	2018/8/24	2018/8/27		398	398		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年8月27日の予定

\*英国休日(Summer Bank Holiday)

◆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