

Central Daily Market Report

2018年8月27日(月)
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27日		2018年8月28日		2018年8月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400	▲ 200				0
財政	4,500	1,800				▲ 4,000
資金過不足	4,900	1,600				▲ 4,000
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	▲ 2,200				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			2,500			
国債買入	9,600					
CP等買入		▲ 300		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	800					
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 1,300	400		1,300		
当預増減	14,100		4,900			▲ 4,000
当座預金残高	3,930,900		3,935,800			3,931,800
準備預金残高	3,434,800					
積み終了先	3,434,100				8月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,434,100				積数	8,100
非準備預金先	496,100				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	99.74%	日数	38.71%		

●2018年8月27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▲0.07~▲0.025%、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▲0.08~▲0.025%近辺のレンジが中心となった。一巡後は▲0.08~▲0.06%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▲0.03%近辺の引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(8/27-8/28)は▲0.12~▲0.10%程度、T/N(8/28-8/29)は▲0.16~▲0.14%程度で出合いが見られた。投資家の資金調達意欲はやや消極的となっている。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、5Y134~136などにビッドが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは小幅低下した。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差▲0.004%、按分落札利回較差▲0.005%としっかりした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.16~▲0.158%、1Y物が▲0.165~▲0.164%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。発行市場は閑散としたマーケットとなり、償還総額500億円程度に対して、発行総額は300億円程度にとどまった。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

2018/8/27	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	0.003	▲ 0.054				-	▲ 0.122	0.090	▲ 0.005	22,799.64	197.87	111.28-30	111.15-16
T/N			0.000				-	▲ 0.146						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.033	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.149						
2W	▲ 0.050	▲ 0.005	▲ 0.024				-	▲ 0.142						
3W							-	▲ 0.141						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.159	▲ 0.142						
6M							▲ 0.165	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.159						
									日付	8/20	8/21	8/22	8/23	8/24
									日銀当預残	3,926,600	3,933,400	3,916,400	3,921,500	3,916,800
									準備預金残	3,436,000	3,440,100	3,423,500	3,427,200	3,423,300
									マネタリーベース	5,020,500	5,027,000	5,009,800	5,016,300	5,011,600
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.063%	▲0.061%	▲0.055%	▲0.053%
									コール市場残高	96,459	94,604	94,391	91,517	94,023
									うち無担	69,727	72,136	75,387	75,382	80,530
									うちO/N	42,822	45,061	48,102	47,097	51,485
									うち有担	26,732	22,468	19,004	16,135	13,493

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国庫短期証券買入	2,500	2018/8/28			8,826	2,503	▲0.005		▲0.004	40.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,000	2018/8/27	2018/8/28		1,327	1,327		▲0.600	▲0.600	

●2018年8月28日の予定

*米国6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(5,000億円、8/29発行)
*米国8月のCB消費者信頼感指数	

◆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