

Central Daily Market Report

2018年8月28日(火)

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28日		2018年8月29日		2018年8月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		300		▲ 1,000	
財政	500		▲ 7,200		1,000	
資金過不足	200		▲ 6,900		0	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	2,500					
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 100		
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			300			
国債補完供給	▲ 900	1,300		900		
当預増減	2,600		▲ 5,800		0	
当座預金残高	3,933,500		3,927,700		3,927,700	
準備預金残高	3,434,100					
積み終了先	3,433,400				8月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,433,400				積数	7,300
非準備預金先	499,400				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	99.77%	日数	41.94%		

●2018年8月28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~▲0.055%近辺の調達希望で始まり、朝方の出会い水準は▲0.08~▲0.025%近辺のレンジが中心となった。一巡後は▲0.086~▲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(8/28-8/29)は▲0.11~▲0.10%程度、T/N(8/29-8/30)は▲0.15~▲0.14%程度で出会いが見られた。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は横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、材料に乏しく閑散とした地合いながらも、3M物で▲0.166~▲0.162%出会いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は月末前倒し発行ということもあって、機械・電力・石油・その他金融業態等から大型発行があり、償還総額2,100億円程度に対して、発行総額は4,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。本日はCP等買入オベがオファー額2,000億円で実施された。結果は平均レート0.001%・按分レート▲0.001%と平均レートが前回(▲0.001%)比で上昇、按分レートが前回から横ばいとなった。

●短期金融市場関連指標

2018/8/28	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	▲ 0.051				-	▲ 0.121	0.090	0.000	22,813.47	13.83	111.12-13	111.14-15
T/N			0.000				-	▲ 0.154						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.158						
2W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.146						
3W			0.005				-	▲ 0.143						
1M	▲ 0.045	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.142						
3M							▲ 0.164	▲ 0.142						
6M							▲ 0.165	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.159						
									日付	8/21	8/22	8/23	8/24	8/27
									日銀当預残	3,933,400	3,916,400	3,921,500	3,916,800	3,930,900
									準備預金残	3,440,100	3,423,500	3,427,200	3,423,300	3,434,100
									マネタリーベース	5,027,000	5,009,800	5,016,300	5,011,600	5,025,400
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.061%	▲0.055%	▲0.053%	▲0.053%
									コール市場残高	94,604	94,391	91,517	94,023	99,344
									うち無担	72,136	75,387	75,382	80,530	83,251
									うちO/N	45,061	48,102	47,097	51,485	48,851
									うち有担	22,468	19,004	16,135	13,493	16,093

●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)
流動性供給	268	-	5,000	2018/8/29		11,298.0	4,997.00		0.0050%	70.9090%		▲0.0010%	

●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
CP等買入	2,000	2018/8/31			6,115	1,985	▲0.001		0.001	64.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	52,133	2018/8/28	2018/8/29		832	832		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/8/30	2018/9/7	2.42	0	0				

●2018年8月29日の予定

*鈴木日銀審議委員沖縄県金融経済懇談会にて講演	*米国4-6月期のGDP改定値	*交付税特別会計借入(10,500億円、9/7借入)
*月例経済報告		
*8月の消費動向調査		

◆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