

Central Daily Market Report

2018年8月29日(水)

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29日		2018年8月30日		2018年8月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 800		▲ 200	
財政	▲ 9,600		▲ 2,100		1,200	
資金過不足	▲ 9,300		▲ 2,900		1,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			3,200			
CP等買入		▲ 100		▲ 300	2,000	
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	▲ 400	900		400		
当預増減	▲ 8,600		400		3,000	
当座預金残高	3,924,900		3,925,300		3,928,300	
準備預金残高	3,427,500					
積み終了先	3,426,900				8月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,426,900				積数 6,700	
非準備預金先	497,400				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	99.79%	日数	45.16%		

●2018年8月29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▲0.075~▲0.055%近辺の調達希望で始まり、朝方の出合い水準は▲0.075~▲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。ターム物はロール案件の取引が中心となった。

<レポ市場>

GC T+0(8/29-8/30)は▲0.11~▲0.10%程度、T/N(8/30-8/31)は▲0.13~▲0.11%程度で出合いが見られた。足元の買いがやや減少し、レートが上昇傾向となっている。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は小幅上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散とした中、3M物が▲0.17~▲0.168%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。発行市場は月末発行にあたり、鉄鋼・ゴム製品・石油・その他金融等の複数の業態からまとまった発行が見られたものの、発行総額7,600億円程度に対して、償還総額は1兆1,300億円程度と償還超の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

2018/8/29	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				-	▲ 0.109	0.095	0.005	22,848.22	34.75	111.14-16	111.18-19
T/N			0.000				-	▲ 0.142						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.032				-	▲ 0.153						
2W	▲ 0.037	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.143						
3W							-	▲ 0.141						
1M							-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.167	▲ 0.141						
6M							▲ 0.168	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.162	▲ 0.159						
									日付	8/22	8/23	8/24	8/27	8/28
									日銀当預残	3,916,400	3,921,500	3,916,800	3,930,900	3,933,500
									準備預金残	3,423,500	3,427,200	3,423,300	3,434,100	3,434,100
									マネタリーベース	5,009,800	5,016,300	5,011,600	5,025,400	5,028,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.061%	▲ 0.055%	▲ 0.053%	▲ 0.053%	▲ 0.051%
									コール市場残高	94,391	91,517	94,023	99,344	98,919
									うち無担	75,387	75,382	80,530	83,251	85,296
									うちO/N	48,102	47,097	51,485	48,851	52,166
									うち有担	19,004	16,135	13,493	16,093	13,623

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2018/9/7	2019/3/8	214,074.0	10,500.22		0.0000%	4.9050%		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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/8/30			1,528	500	0.038		0.040	93.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/8/30			6,321	1,823	0.008		0.009	42.2
国債買入(残存期間25年超)	600	2018/8/30			2,232	605	0.010		0.010	89.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	35,638	2018/8/29	2018/8/30		395	395		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年8月30日の予定

*7月の商業動態統計速報	*米7月の個人所得・消費支出	*2年利付国債入札(21,000億円、9/3発行)
--------------	----------------	---------------------------

◆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