Central Daily Market Report

2018年8月30日（木）
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30日 需給速報		2018年8月31日 需給予想		2018年9月3日 当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 100		1,000	
財政	▲ 1,500		500		▲ 36,000	
資金過不足	▲ 2,300		400		▲ 35,000	
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						▲ 1,100
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		▲ 300	2,000	▲ 2,100		
貸出支援基金(成)						▲ 6,600
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ＥＴＦ買入			500			
国債補完供給	▲ 300	400		300		
当預増減	700		1,000		▲ 42,700	

当座預金残高	3,925,600	3,926,600	3,883,900
準備預金残高	3,419,700		
積み終了先	3,419,100		
超過準備	3,419,100		
非準備預金先	505,900		

8月31日以降の残り所要積立額	
積数	6,100
1日平均	400

積み期間（8/16～9/15）の所要準備額			3,120,200
準備預金進捗率	実績	99.80%	日数 48.39%

●2018年8月30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～▲0.04%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(8/30-8/31)は▲0.11～▲0.10%程度、T/N(8/31-9/3)は▲0.16～▲0.095%程度で出合いが見られた。T/Nは月末を挟む取引にあたり、警戒感から強い水準で寄りついたが、一部投資家の資金調達意欲も見られ、レートは上昇傾向で推移した。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、5Y134～136などにビッドが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは末初に該当したものの、上昇した。アウトライト市場は、動意なく閑散とした中、3M物が▲0.174%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、石油・食料品業態からまとまった発行が見られ、発行総額2,300億円程度に対して、償還総額は600億円程度と発行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

2018/8/30	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.051				－	▲ 0.107
T/N			0.000				－	▲ 0.142
S/N							－	－
1W	▲ 0.033	▲ 0.023	▲ 0.024				－	▲ 0.134
2W			▲ 0.035				－	▲ 0.131
3W							－	▲ 0.134
1M	▲ 0.020	0.090	0.002				－	▲ 0.139
3M							▲ 0.167	▲ 0.141
6M							▲ 0.168	▲ 0.149
1Y							▲ 0.162	▲ 0.159

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.105	0.010	22,869.50	21.28	111.68-70	111.61-62

日付	8/23	8/24	8/27	8/28	8/29
日銀当預残	3,921,500	3,916,800	3,930,900	3,933,500	3,924,900
準備預金残	3,427,200	3,423,300	3,434,100	3,434,100	3,427,500
マネタリーベース	5,016,300	5,011,600	5,025,400	5,028,300	5,019,400
無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.053%	▲0.053%	▲0.051%	▲0.053%
コール市場残高	91,517	94,023	99,344	98,919	102,474
うち無担	75,382	80,530	83,251	85,296	86,527
うちO/N	47,097	51,485	48,851	52,166	53,107
うち有担	16,135	13,493	16,093	13,623	15,947

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
2年利付国債	392	0.10%	21,000	2018/9/3	2020/9/1	92,002.0	17,485.00	100.4250	▲0.1120%	93.8200%	100.4250	▲0.1120%	3,511.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	20,000	2018/8/30	2018/8/31		241	241		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	9,878	2018/8/30	2018/8/31		58	58		▲0.600	▲0.600	

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円・百万ドル）	貸付先数
成長基盤強化	本則第33回	2018/9/3	2022/9/2	0	2,910	38
成長基盤強化	ABL等特則第29期	2018/9/4	2022/9/2	0	8	2
成長基盤強化	小口特則第26期	2018/9/3	2022/9/2	0	7.66	8
成長基盤強化	米ドル特則第25期	2018/9/5	2019/9/5		1,399	18
成長基盤強化	米ドル特則第21期(借り換え)	2018/9/5	2019/9/5		1,635	23
成長基盤強化	米ドル特則第17期(借り換え)	2018/9/5	2019/9/5		3,789	26
成長基盤強化	米ドル特則第13期(借り換え)	2018/9/5	2019/9/5		9	9

●2018年8月31日の予定

*7月の完全失業率（市場予想：2.4%）*7月の有効求人倍率（市場予想：1.62倍）
*8月の都区部消費者物価指数（CPI）（市場予想：前年同月比（除く生鮮）＋0.8%）
*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報（市場予想：前月比＋0.2%）*7月の住宅着工統計
*国庫短期証券（780回）入札（3ヶ月、42,500億円、9/3発行）
*米国8月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏8月の消費者物価指数速報値

◆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。
◆本資料は何ら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論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