

Central Daily Market Report

2018年8月31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31日		2018年9月3日		2018年9月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		800		1,000	
財政	800		▲ 41,200		▲ 32,000	
資金過不足	800		▲ 40,400		▲ 31,000	
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			1,300	▲ 1,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,700			
CP等買入	2,000	▲ 2,100		▲ 100		
貸出支援基金(成)			2,900	▲ 4,600		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入	500					
国債補完供給	▲ 1,800	300		1,800		
当預増減	▲ 400		▲ 30,500		▲ 31,000	
当座預金残高	3,925,200		3,894,700		3,863,700	
準備預金残高	3,444,400					
積み終了先	3,443,900				9月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,443,900				積数 4,500	
非準備預金先	480,800				1日平均 300	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					3,121,300	
準備預金進捗率	実績	99.86%	日数	58.06%		

●2018年8月31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▲0.086~▲0.055%近辺の調達希望で始まり、朝方の出会い水準は▲0.086~▲0.025%近辺の幅広いレンジとなった。一巡後は▲0.086~▲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。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1,291億円(期落ち額1,141億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(8/31-9/3)は▲0.10~▲0.09%程度、T/N(9/3-9/4)は▲0.105~▲0.095%程度で出会いが見られた。T/NはTDB3M物発行日にあたり、業者の売物は増加している。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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.155~▲0.15%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1531%、按分落札利回▲0.1463%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは、▲0.153~▲0.148%出会いと底堅く推移した。

<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、機械業態から大型発行が見られたものの案件数は少なく、発行総額900億円程度に留まった。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

2018/8/31	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	▲ 0.055				-	▲ 0.098	0.100	▲ 0.005	22,865.15	▲ 4.35	111.01-02	110.80-81
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.108						
2W							-	▲ 0.112						
3W							-	▲ 0.117						
1M							-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.150	▲ 0.136						
6M							▲ 0.165	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.162	▲ 0.157						
									日付	8/24	8/27	8/28	8/29	8/30
									日銀当預残	3,916,800	3,930,900	3,933,500	3,924,900	3,925,600
									準備預金残	3,423,300	3,434,100	3,434,100	3,427,500	3,423,900
									マネタリーベース	5,011,600	5,025,400	5,028,300	5,019,400	5,020,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.053%	▲ 0.053%	▲ 0.051%	▲ 0.053%	▲ 0.050%
									コール市場残高	94,023	99,344	98,919	102,474	98,520
									うち無担	80,530	83,251	85,296	86,527	83,988
									うちO/N	51,485	48,851	52,166	53,107	52,518
									うち有担	13,493	16,093	13,623	15,947	14,532

●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	780	-	42,500	2018/9/3	2018/12/3	129,890.0	34,776.2	100.0365	▲0.1463%	56.5598%	100.0382	▲0.1531%	7,723.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/9/3	2018/9/18		1,291	1,291				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/9/3			8,249	2,507	▲0.002		0.000	1.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/9/3			10,249	3,004	▲0.004		▲0.004	53.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2018/9/3			13,573	4,012	▲0.004		▲0.004	76.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	57,135	2018/8/31	2018/9/3		1,601	1,601		▲0.600	▲0.605	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,945	2018/8/31	2018/9/3		125	125		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月3日の予定

*黒田日銀総裁、株価指数先物30周年記念シンポジウムにて講演	*New York祝日(Labor Day)	*流動性供給入札(6,000億円、9/4発行)
*4-6月期の法人企業統計調査季報		

◆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