

Central Daily Market Report

2018年8月13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13日		2018年8月14日		2018年8月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 300				0
財政	▲ 7,200	▲ 3,300				85,000
資金過不足	▲ 7,100	▲ 3,600				85,000
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	▲ 2,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	8,400					
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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			700			
国債補完供給	▲ 3,000	1,900		3,000		
当預増減	▲ 400		4,800			85,000
当座預金残高	3,843,900		3,848,700			3,933,700
準備預金残高	3,368,500					
積み終了先	3,368,300				8月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,368,300				積数	300
非準備預金先	475,400				1日平均	100
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額						3,136,200
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	93.55%		

●2018年8月13日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態の調達意欲に落ち着きが見られ、先週末と比べてやや低い水準での取引となった。立ち上がりは地銀業態から▲0.06~▲0.03%、都銀・信託・証券業態などからは▲0.08~▲0.06%近辺の調達希望ではじまり、朝方の出会いの水準は▲0.07~▲0.03%の幅広いレンジとなった。一巡後はビットサイドが取り下がり、▲0.08~▲0.07%近辺で取引が行われた。ターム物はロール案件の引き合いが中心であった。

<レポ市場>

GC T+0(8/13-8/14)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。T/N(8/14-8/15)は、▲0.10~▲0.09%程度での出合い。T/Nは短国買入オペアが通知されたが、大きなレート低下は見られなかった。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。10Y339~351、5Y130~136、20Y165などにビットの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペアが5,000億円(前回比+2,500億円)でオファーされた。応札額が15,372億円とやや多かったものの、平均落札利回較差▲0.005%、按分落札利回較差▲0.007%としっかりした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.165~▲0.16%、1Y物が一時▲0.17%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は15日発行となり、石油、小売、商社業態からまとまった発行が見られ、総額1,350億円程度に達した。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

2018/8/13	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.095	0.095	▲ 0.005	21,857.43	▲ 440.65	110.63-64	110.18-20
T/N			0.000				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.028	▲ 0.032				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.028				-	▲ 0.112						
3W			0.000				-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.163	▲ 0.132						
6M							▲ 0.170	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.142	▲ 0.156						
									日付	8/6	8/7	8/8	8/9	8/10
									日銀当預残	3,846,800	3,852,000	3,846,100	3,853,700	3,844,300
									準備預金残	3,366,100	3,383,400	3,373,900	3,377,000	3,377,500
									マネタリーベース	4,940,600	4,945,600	4,939,400	4,947,400	4,938,400
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.066%	▲0.060%	▲0.055%	▲0.047%
									コール市場残高	99,560	95,440	108,800	107,657	100,566
									うち無担	72,742	71,689	83,815	86,514	77,848
									うちO/N	43,677	44,274	55,520	60,769	52,053
									うち有担	26,818	23,751	24,985	21,143	22,718

●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)	応募額(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	5,000	2018/8/14			15,372	5,003	▲0.007		▲0.005	74.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	84,317	2018/8/13	2018/8/14		2,912	2,912		▲0.500	▲0.515	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2018/8/13	2018/8/14		12	12		▲0.500	▲0.500	

●2018年8月14日の予定

*ユーロ圏4-6月期のGDP2次速報

◆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