

Central Daily Market Report

2018年8月14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14日 需給速報	2018年8月15日 需給予想	2018年8月16日 当社予想
銀行券	▲ 200	0	0
財政	▲ 5,700	82,600	0
資金過不足	▲ 5,900	82,600	0
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	5,000		
国債買入			
CP等買入		▲ 300	▲ 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			▲ 100
E T F買入	700		
国債補完供給	▲ 2,700	3,000	2,700
当預増減	▲ 200	84,900	0
当座預金残高	3,843,700	3,928,600	3,928,600
準備預金残高	3,365,000		
積み終了先	3,364,900		8月15日以降の残り所要積立額
超過準備	3,364,900		積数
非準備預金先	478,700		1日平均
			200
			200
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
			96.77%

●2018年8月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は昨日比横ばいの動き。朝方は地銀・証券・都銀・信託業態から▲0.070~▲0.030%の調達希望で立ち上がり、▲0.060~▲0.030%中心の出合いとなった。出合い一巡後は▲0.080~▲0.070%で調整の動きが見られた。ターム物はショートタームで▲0.040%程度の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(8/14-8/15)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。T/N(8/15-8/16)は、▲0.125~▲0.095%程度での出合い。T/Nは積み最終日にあたり、序盤は資金調達ニーズも見られたことでレートは高めで推移したが、まとまった資金調達ニーズがなくなった後は低下した。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。10Y339~351、5Y130~136、20Y165などにビッド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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.165%、6M物が▲0.18%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は案件、金額共に少なく閑散。本日2,000億円で開催されたCP等買入オペアは、平均レート、按分レート共に▲0.001%と前回オペア比で共に横ばいであった。

●短期金融市場関連指標

2018/8/14	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	0.100	0.005	22,356.08	498.65	110.63-64	111.10-11
T/N	▲ 0.035	0.000	▲ 0.018				-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.050	▲ 0.028	▲ 0.042				-	▲ 0.113						
3W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.036				-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.163	▲ 0.133						
6M							▲ 0.172	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.142	▲ 0.156						
									日付	8/7	8/8	8/9	8/10	8/13
									日銀当預残	3,852,000	3,846,100	3,853,700	3,844,300	3,843,900
									準備預金残	3,383,400	3,373,900	3,377,000	3,377,500	3,368,500
									マネタリーベース	4,945,600	4,939,400	4,947,400	4,938,400	4,937,900
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.060%	▲0.055%	▲0.047%	▲0.051%
									コール市場残高	95,440	108,800	107,657	100,566	102,487
									うち無担	71,689	83,815	86,514	77,848	78,123
									うちO/N	44,274	55,520	60,769	52,053	51,978
									うち有担	23,751	24,985	21,143	22,718	24,364

●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
CP等買入	2,000	2018/8/17			6,431	1,941	▲0.001		▲0.001	80.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	93,723	2018/8/14	2018/8/15		2,605	2,605		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/8/16	2018/8/23	2.41	1	1				

●2018年8月15日の予定

*米国6月の企業在庫	*英国7月の消費者物価指数	*国有林野借入(966億円、8/27借入)
*米国7月の小売売上高		
*米国7月の鉱工業生産・設備稼働率		

◆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