

Central Daily Market Report

2018年8月15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15日		2018年8月16日		2018年8月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 400	▲ 1,000			
財政	82,100	▲ 400	▲ 15,000			
資金過不足	82,200	▲ 800	▲ 16,000			
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			6,700			
CP等買入		▲ 300			1,900	
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						
国債補完供給	▲ 2,400	2,700		2,400		
当預増減	82,100	8,300	▲ 14,100			
当座預金残高	3,925,800	3,934,100	3,920,000			
準備預金残高	3,445,800					
積み終了先	3,445,800					
超過準備	3,445,600					
非準備預金先	480,000					
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	0.00%	日数	0.00%		

●2018年8月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は年金定時払い及び積み最終日に当たり、強弱入り乱れた展開となった。▲0.060%で寄り付き後は、都銀・地銀・証券・信託業態から▲0.070~▲0.030%の出合い。一巡後は、調達に目途をつけた参加者が出始めたこともあり、▲0.085~▲0.070%と水準を切下げての出合いとなった。午後は調整から▲0.060~▲0.035%が出合って本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで▲0.040~▲0.035%の出合い。

<レポ市場>

GC T+0(8/15-8/16)は、▲0.13~▲0.11%程度の出合い。T/N(8/16-8/17)は、▲0.18~▲0.14%程度での出合い。T/Nは新積み期に入ったことで投資家の資金調達が弱まったため、レートが大きく低下した。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は低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.163%、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。発行市場は食料品業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は480億円程度と閑散。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

2018/8/15	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.117	0.090	▲ 0.010	22,204.22	▲ 151.86	111.25-26	111.33-34
T/N			0.000				-	▲ 0.145						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.041				-	▲ 0.134						
2W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.040				-	▲ 0.132						
3W			▲ 0.045				-	▲ 0.134						
1M							-	▲ 0.133						
3M							▲ 0.163	▲ 0.139						
6M							▲ 0.170	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.156						
									日付	8/8	8/9	8/10	8/13	8/14
									日銀当預残	3,846,100	3,853,700	3,844,300	3,843,900	3,843,700
									準備預金残	3,373,900	3,377,000	3,377,500	3,368,500	3,365,000
									マネタリーベース	4,939,400	4,947,400	4,938,400	4,937,900	4,937,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.060%	▲ 0.055%	▲ 0.047%	▲ 0.051%	▲ 0.051%
									コール市場残高	108,800	107,657	100,566	102,487	105,728
									うち無担	83,815	86,514	77,848	78,123	82,668
									うちO/N	55,520	60,769	52,053	51,978	56,313
									うち有担	24,985	21,143	22,718	24,364	23,060

●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)
国有林野借入	-	-	966	2018/8/27	2023/8/25	3,283.0	966.00		0.0010%	100.0000%		0.0010%	

●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5年超10年以下)	4,000	2018/8/16			11,175	4,017	▲ 0.004		▲ 0.003	31.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/8/16			6,043	1,809	0.003		0.005	3.7
国債買入(残存期間25年超)	600	2018/8/16			2,299	605	0.003		0.004	89.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,108	2018/8/15	2018/8/16		2,382	2,382		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/8/15	2018/8/16		4	4		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年8月16日の予定

*7月の貿易統計	*米国7月の住宅着工件数	*国庫短期証券(777回)入札 (1年、21,000億円、8/20発行) *5年利付国債入札 (20,000億円、8/17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