

Central Daily Market Report

2018年8月16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16日		2018年8月17日		2018年8月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 200			0
財政	600		▲ 14,300			▲ 8,000
資金過不足		200		▲ 14,500		▲ 8,000
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
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			1,900	▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 2,200	2,400		2,200		
当預増減		7,100		▲ 10,500		▲ 9,300
当座預金残高		3,932,900		3,922,400		3,913,100
準備預金残高		3,439,500				
積み終了先		2,152,000			8月17日以降の残り所要積立額	
超過準備		923,900			積数	605,000
非準備預金先		493,400			1日平均	20,200
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	80.61%	日数		3.23%

●2018年8月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は積み前の初日で慎重な調達姿勢の立ち上がりとなり、レートは低下の動きとなった。朝方は都銀・地銀・証券・信託業態から▲0.086~▲0.045%の調達希望から始まった。▲0.080%で寄り付き後は▲0.080~▲0.040%のレンジでの出会いが中心となった。一巡後は▲0.080%で調整の出会い。午後は特段出会いが見られなかった。ターム物は月内のショートタームで▲0.040~▲0.025%の出会い。

<レポ市場>

GC T+0(8/16-8/17)は、▲0.18~▲0.11%程度での出会い。T/N(8/17-8/20)は、▲0.17~▲0.15%程度での出会い。昨日のT/Nと比べると若干上昇しているものの、引き続き低いレートでの出会いとなっている。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。10Y339~351、5Y130~136、20Y165、40Y11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。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.16%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1557%、按分落札利回▲0.1537%と強めの結果となった。セカンダリーでは、▲0.16~▲0.155%の出会いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.16~▲0.158%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20日発行となり、銘柄に若干の広がりは見られたものの、大型の発行は鉄鋼業態1社のみと、発行総額は1,300億円程度にとどまった。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

2018/8/16	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	▲ 0.067				-	▲ 0.111	0.095	0.005	22,192.04	▲ 12.18	110.58-59	110.77-79
T/N			0.000				-	▲ 0.150						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.034				-	▲ 0.133						
2W	▲ 0.050	▲ 0.038	▲ 0.041				-	▲ 0.133						
3W							-	▲ 0.135						
1M							-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.158	▲ 0.139						
6M							▲ 0.170	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.157						
									日付	8/9	8/10	8/13	8/14	8/15
									日銀当預残	3,853,700	3,844,300	3,843,900	3,843,700	3,925,800
									準備預金残	3,377,000	3,377,500	3,368,500	3,365,000	3,445,800
									マネタリーベース	4,947,400	4,938,400	4,937,900	4,937,900	5,019,900
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.047%	▲0.051%	▲0.051%	▲0.052%
									コール市場残高	107,657	100,566	102,487	105,728	99,954
									うち無担	86,514	77,848	78,123	82,668	76,331
									うちO/N	60,769	52,053	51,978	56,313	51,936
									うち有担	21,143	22,718	24,364	23,060	23,623

●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	777	-	21,000	2018/8/20	2019/8/20	91,175.0	17,752.7	100.1540	▲0.1537%	84.9473%	100.1560	▲0.1557%	3,247.0
5年利付国債	136	0.10%	20,000	2018/8/17	2023/6/20	67,561.0	17,110.0	100.8500	▲0.0740%	37.0117%	100.8600	▲0.0760%	2,884.0

●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)	84,630	2018/8/16	2018/8/17		2,129	2,129		▲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	2018/8/16	2018/8/17		4	4		▲0.600	▲0.600	

●2018年8月17日の予定

*6月の石油等消費動態統計	*米国8月のミシガン大学消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(778回)入札(3ヶ月、42,500億円、8/20発行)
	*ユーロ圏7月の消費者物価指数改定値	*交付税特別会計借入(10,500億円、8/28借入)

◆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