

Central Daily Market Report

2018年8月17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17日		2018年8月20日		2018年8月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		500		1,000	
財政	▲ 13,700		▲ 8,100		3,000	
資金過不足	▲ 13,700		▲ 7,600		4,000	
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			1,100	▲ 1,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			6,600			
CP等買入	1,900	▲ 100		▲ 400		
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						
国債補充供給		2,200				
当預増減	▲ 9,700		▲ 1,600		4,000	
当座預金残高	3,923,200		3,921,600		3,925,600	
準備預金残高	3,439,900					
積み終了先	3,422,200				8月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,251,300				積数	
非準備預金先	483,300				1日平均	
					1,500	
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		98.74%		日数	
					12.90%	

●2018年8月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は前日比横ばい。▲0.080%で寄り付いた後は都銀・地銀・証券業態から▲0.086~▲0.040%のレンジでの出合いが中心となった。一巡後は▲0.080%で調整の出合い。午後は特段の出合いが見られなかった。ターム物はロール案件の引合いが散見された程度であった。

<レポ市場>

GC T+0(8/17-8/20)は、▲0.11~▲0.105%程度の出合い。T/N(8/20-8/21)は、▲0.125~▲0.10%程度での出合い。T/Nは短国3ヶ月物、1年物の発行が重なりレート上昇となった。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、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は発行要因からか小幅上昇。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▲0.18~▲0.17%での強めの出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1643%、按分落札利回▲0.1563%と引き続き強めの結果となった。セカンダリーでは、▲0.165~▲0.156%出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、1Y物が▲0.16~▲0.157%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であった。

●短期金融市場関連指標

2018/8/17	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	▲ 0.067				-	▲ 0.111	0.090	▲ 0.005	22,270.38	78.34	111.00-02	110.70-72
T/N			0.000				-	▲ 0.139						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.017				-	▲ 0.133						
3W							-	▲ 0.133						
1M							-	▲ 0.134						
3M							▲ 0.157	▲ 0.139						
6M							▲ 0.167	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.157						
									日付	8/10	8/13	8/14	8/15	8/16
									日銀当預残	3,844,300	3,843,900	3,843,700	3,925,800	3,932,900
									準備預金残	3,377,500	3,368,500	3,365,000	3,445,800	3,439,600
									マネタリーベース	4,938,400	4,937,900	4,937,900	5,019,900	5,027,400
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.051%	▲0.051%	▲0.052%	▲0.067%
									コール市場残高	100,566	102,487	105,728	99,954	89,562
									うち無担	77,848	78,123	82,668	76,331	72,568
									うちO/N	52,053	51,978	56,313	51,936	46,443
									うち有担	22,718	24,364	23,060	23,623	16,994

●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	778	-	42,500	2018/8/20	2018/11/19	160,563.4	35,919.4	100.0390	▲0.1563%	89.3287%	100.0410	▲0.1643%	6,580.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/8/28	2019/2/28	215,633.0	10,500.05		0.0000%	4.8695%		0.0000%	

●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	2018/8/20	2018/9/3		1,141	1,141				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/8/20			9,734	2,507	▲0.008		▲0.006	2.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/8/20			11,116	3,005	▲0.004		▲0.003	52.3
国債買入(変動利付債)	1,000	2018/8/20			2,738	1,002	▲0.140		▲0.208	41.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	34,765	2018/8/17	2018/8/20		34	34		▲0.600	▲0.600	

●2018年8月20日の予定

*特にありません。

◆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