

Central Daily Market Report

2018年8月20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20日		2018年8月21日		2018年8月22日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	500	400			▲ 1,000	
財政	▲ 2,900	1,600			▲ 11,000	
資金過不足	▲ 2,400	2,000			▲ 12,000	
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			5,000			
国債買入	6,600					
CP等買入		▲ 400		▲ 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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 200		200			
当預増減	3,400	7,100			▲ 12,000	
当座預金残高	3,926,600	3,933,700	3,921,700			
準備預金残高	3,436,000					
積み終了先	3,426,900			8月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,423,100			積数	26,400	
非準備預金先	490,600			1日平均	1,000	
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	99.15%	日数	16.13%		

●2018年8月20日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は先週末比横ばいの地合いであった。▲0.085%で寄り付いた後は都銀・地銀・証券業態から▲0.085~▲0.040%のレンジが中心の出合いとなった。一巡後は▲0.086~▲0.080%で調整の出合い。また、一部邦銀の試し取りから+0.001%の出合いも見られた。ターム物はショートタームで▲0.040%の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(8/20-8/21)は▲0.12~▲0.09%程度、T/N(8/21-8/22)は▲0.125~▲0.10%程度で出合いが見られた。レートはほぼ横ばい圏で、オファー、ビッド共に様子見姿勢が強かった。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。個別銘柄では10Y340~351、5Y131~135、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は横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペが5,000億円(前回と同額)でオファーされた。応札額が16,421億円とやや多かったものの、平均落札利回較差+0.001%、按分落札利回較差±0.000%と落ち着いた結果となった。マーケットでは3M物が▲0.157~▲0.155%、1Y物が▲0.159~▲0.155%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額150億円程度に対して、発行総額は450億円程度と若干の発行超であった。案件数が少なく全般的に閑散としたマーケットとなった。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

2018/8/20	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	▲ 0.066				-	▲ 0.100	0.090	0.000	22,199.00	▲ 71.38	110.48-49	110.61-62
T/N			0.000				-	▲ 0.120						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.230	▲ 0.005				-	▲ 0.124						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.129						
3W							-	▲ 0.130						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.156	▲ 0.139						
6M							▲ 0.165	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.156	▲ 0.157						
									日付	8/13	8/14	8/15	8/16	8/17
									日銀当預残	3,843,900	3,843,700	3,925,800	3,932,900	3,923,200
									準備預金残	3,368,500	3,365,000	3,445,800	3,439,600	3,439,900
									マネタリーベース	4,937,900	4,937,900	5,019,900	5,027,400	5,017,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.051%	▲ 0.051%	▲ 0.052%	▲ 0.067%	▲ 0.067%
									コール市場残高	102,487	105,728	99,954	89,562	91,035
									うち無担	78,123	82,668	76,331	72,568	74,795
									うちO/N	51,978	56,313	51,936	46,443	48,400
									うち有担	24,364	23,060	23,623	16,994	16,240

●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	2018/8/21			16,421	5,004	0.000		0.001	51.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	130,700	2018/8/20	2018/8/21		179	179		▲ 0.600	▲ 0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第88回 2018/8/24	2019/8/23	0	428
被災地金融支援オペ(熊本)	第27回 2018/8/24	2019/8/23	0	500

●2018年8月21日の予定

*20年利付国債入札
(10,000億円、8/22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