

Central Daily Market Report

2018年8月21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21日		2018年8月22日		2018年8月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		100		▲ 1,000	
財政	1,400		▲ 14,100		▲ 1,000	
資金過不足	1,800		▲ 14,000		▲ 2,000	
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	5,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 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	▲ 100	200		100		
当預増減	6,800		▲ 14,000		▲ 2,000	
当座預金残高	3,933,400		3,919,400		3,917,400	
準備預金残高	3,440,100					
積み終了先	3,432,700					
超過準備	3,431,800					
非準備預金先	493,300					
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	99.42%	日数	19.35%		

●2018年8月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀業態から▲0.06~▲0.04%、都銀・信託・証券業態から▲0.086~▲0.075%近辺の調達希望ではじまった。朝方の出合いの水準は▲0.085~▲0.04%の幅広いレンジとなった。一巡後は▲0.086~▲0.08%近辺で取引が行われた他、試し取りによる+0.001%での出合いも散見された。ターム物はロール案件の引き合いが中心であった。

<レポ市場>

GC T+0(8/21-8/22)は▲0.105~▲0.09%程度、T/N(8/22-8/23)は▲0.125~▲0.11%程度で出合いが見られた。引き続き様子見姿勢の参加者が多く、レートは横ばい圏での取引だった。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などにビッドが目立った。リオープンとなった20Y165は緩んだが、甘めの水準ではビッド気配も見えた。

<短国市場>

現先T/Nは横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<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600億円強に対して、発行総額は1,000億円弱と若干の発行超であった。案件数はやや膨らんだものの、小型発行を中心とした落ち着い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

2018/8/21	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	0.010	▲ 0.063				-	▲ 0.099	0.085	▲ 0.005	22,219.73	20.73	109.95-96	110.16-17
T/N			0.000				-	▲ 0.114						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.048	▲ 0.030	▲ 0.042				-	▲ 0.121						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.025				-	▲ 0.126						
3W							-	▲ 0.129						
1M							-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.156	▲ 0.138						
6M							▲ 0.164	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.156	▲ 0.157						
									日付	8/14	8/15	8/16	8/17	8/20
									日銀当預残	3,843,700	3,925,800	3,932,900	3,923,200	3,926,600
									準備預金残	3,365,000	3,445,800	3,439,600	3,439,900	3,436,000
									マネタリーベース	4,937,900	5,019,900	5,027,400	5,017,600	5,020,500
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.052%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.066%
									コール市場残高	105,728	99,954	89,562	91,035	96,459
									うち無担	82,668	76,331	72,568	74,795	69,727
									うちO/N	56,313	51,936	46,443	48,400	42,822
									うち有担	23,060	23,623	16,994	16,240	26,732

●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)
20年利付国債	165	0.50%	10,000	2018/8/22	2038/6/20	37,551.0	8,058.00	98.0500	0.6100%	15.0048%	98.1000	0.6070%	1,935.0

●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
社債等買入	750	2018/8/27			2,230	750	▲0.049		▲0.036	35.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2018/8/21	2018/8/22		63	63		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/8/23	2018/8/30	2.42	2	2				

●2018年8月22日の予定

*米国7月の中古住宅販売

◆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