

# Central Daily Market Report

2018年8月22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22日		2018年8月23日		2018年8月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 1,400		▲ 1,000	
財政	▲ 16,900		900		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 16,700		▲ 500		▲ 6,000	
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			7,100			
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					900	▲ 900
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	▲ 17,000		6,600		▲ 6,000	
当座預金残高	3,916,400		3,923,000		3,917,000	
準備預金残高	3,423,500					
積み終了先	3,420,200		8月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,419,300		積数		14,000	
非準備預金先	492,900		1日平均		600	
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	99.55%	日数	22.58%		

## ●2018年8月22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▲0.08~▲0.04%、都銀・信託・証券業態等から▲0.085~▲0.07%近辺の調達希望ではじまった。朝方の出合い水準は▲0.085~▲0.04%の幅広いレンジとなったが、一巡後は▲0.085~▲0.075%近辺で取引が行われた。ターム物は1W物で▲0.04%近辺の引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T+0(8/22-8/23)は▲0.11~▲0.09%程度、T/N(8/23-8/24)は▲0.14~▲0.11%程度で出合いが見られた。調達サイドがやや薄く、一時レートを下げて出合う場面もあった。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。

### <短国市場>

現先レートT/Nは小幅低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.156~▲0.155%、6M物が▲0.17%、1Y物が▲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2,300億円弱に対して、発行総額は1,800億円程度と償還超であった。その他金融・食料品業態において大型案件が見られたものの、案件数は膨らまず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

2018/8/22	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	▲ 0.061				-	▲ 0.101	0.090	0.005	22,362.55	142.82	110.11-13	110.41-42
T/N			0.000				-	▲ 0.122						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.041	▲ 0.040	▲ 0.040				-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.038	▲ 0.010	▲ 0.024				-	▲ 0.129						
3W							-	▲ 0.131						
1M							-	▲ 0.133						
3M							▲ 0.155	▲ 0.139						
6M							▲ 0.163	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.157						
									日付	8/15	8/16	8/17	8/20	8/21
									日銀当預残	3,925,800	3,932,900	3,923,200	3,926,600	3,933,400
									準備預金残	3,445,800	3,439,600	3,439,900	3,436,000	3,440,100
									マネタリーベース	5,019,900	5,027,400	5,017,600	5,020,500	5,027,000
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.066%	▲0.063%
									コール市場残高	99,954	89,562	91,035	96,459	94,604
									うち無担	76,331	72,568	74,795	69,727	72,136
									うちO/N	51,936	46,443	48,400	42,822	45,061
									うち有担	23,623	16,994	16,240	26,732	22,468

## ●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	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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2018/8/23			13,436	4,013	0.001		0.001	65.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/8/23			6,760	1,819	▲0.002		▲0.002	77.9
国債買入(残存期間25年超)	600	2018/8/23			1,578	606	0.000		0.002	10.2
国債買入(物価連動債)	250	2018/8/23			1,293	251	▲0.160		▲0.208	52.2
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	39,144	2018/8/22	2018/8/23		278	278		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年8月23日の予定

*6月の景気動向指数改訂状況	*米国7月の新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札(6,000億円、8/24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