Central Daily Market Report

2018年8月23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23日 需給速報		2018年8月24日 需給予想		2018年8月27日 当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 200		0	
財政	▲ 200		▲ 4,400		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 1,600		▲ 4,600		▲ 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						▲ 2,200
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		▲ 300		▲ 400		
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				▲ 100	800	
ＥＴＦ買入			700			
国債補完供給	▲ 400	300		400		
当預増減	5,100		▲ 4,000		▲ 5,400	

当座預金残高	3,921,500	3,917,500	3,912,100
準備預金残高	3,427,200		
積み終了先	3,424,600		
超過準備	3,424,400		
非準備預金先	494,300		

8月24日以降の残り所要積立額	
積数	11,300
1日平均	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	99.64%	日数 25.81%

●2018年8月23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▲0.075～▲0.04%、都銀・信託・証券業態等から▲0.08～▲0.06%近辺の調達希望ではじまった。朝方の出合い水準は▲0.075～▲0.04%の幅広いレンジとなったが、一巡後は▲0.086～▲0.075%近辺で取引が行われた。ターム物は1～2W物のショートタームで▲0.04%近辺の引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(8/23-8/24)は▲0.10～▲0.09%程度、T/N(8/24-8/27)は▲0.15～▲0.11%程度で出合いが見られた。T/Nは週末を跨ぐ取引となり、調達サイドが慎重だった。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。

<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、3M物の入札を控え、閑散な中、3M物が▲0.156～▲0.155%、1Y物が▲0.157～▲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2,700億円強に対して、発行総額は2,100億円程度と償還超であった。一部の不動産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

2018/8/23	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.055				－	▲ 0.104
T/N			0.000				－	▲ 0.138
S/N							－	－
1W	▲ 0.042	▲ 0.040	▲ 0.041				－	▲ 0.132
2W			▲ 0.038				－	▲ 0.137
3W							－	▲ 0.137
1M							－	▲ 0.137
3M							▲ 0.155	▲ 0.140
6M							▲ 0.163	▲ 0.148
1Y							▲ 0.155	▲ 0.157

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.090	0.000	22,410.82	48.27	110.58-59	110.79-81

日付	8/16	8/17	8/20	8/21	8/22
日銀当預残	3,932,900	3,923,200	3,926,600	3,933,400	3,916,400
準備預金残	3,439,600	3,439,900	3,436,000	3,440,100	3,423,500
マネタリーベース	5,027,400	5,017,600	5,020,500	5,027,000	5,009,800
無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.067%	▲0.066%	▲0.063%	▲0.061%
コール市場残高	89,562	91,035	96,459	94,604	94,391
うち無担	72,568	74,795	69,727	72,136	75,387
うちO/N	46,443	48,400	42,822	45,061	48,102
うち有担	16,994	16,240	26,732	22,468	19,004

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
流動性供給	267	－	6,000	2018/8/24		18,585.0	5,984.00		▲0.0020%	90.3215%		▲0.0030%	

●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）	75,224	2018/8/23	2018/8/24		390	390		▲0.600	▲0.600	

●2018年8月24日の予定

*7月の全国消費者物価指数（CPI）
市場予想：前年同月比（除く生鮮）＋0.9%
*7月の企業向けサービス価格指数

*米国7月の耐久財新規受注

*国庫短期証券（779回）入札
（3ヶ月、42,500億円、8/27発行）
*交付税特別会計借入
（10,500億円、9/4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。
◆本資料は何ら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論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