

# Central Daily Market Report

2018年9月3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9月3日 需給速報	2018年9月4日 需給予想	2018年9月5日 当社予想
銀行券	700	300	1,000
財政	▲ 40,700	▲ 28,000	▲ 4,000
資金過不足	▲ 40,000	▲ 27,700	▲ 3,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	1,300	▲ 1,100	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			2,500
国債買入	9,700		
CP等買入		▲ 100	
貸出支援基金(成)	2,900	▲ 4,600	
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入			▲ 200
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 400	1,800	400
当預増減	▲ 30,500	▲ 25,000	▲ 3,000
当座預金残高	3,894,700	3,869,700	3,866,700
準備預金残高	3,409,000		
積み終了先	3,408,300		
超過準備	3,408,300		
非準備預金先	485,700		
9月4日以降の残り所要積立額			
積数			
3,900			
1日平均			
300			
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			
3,121,300			
準備預金進捗率			
実績 99.88% 日数 61.29%			

## ●2018年9月3日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態から▲0.086~▲0.055%、地銀業態から▲0.075~▲0.025%近辺の調達希望で始まった。月末要因が剥落し若干の取り上がりが見られ、朝方の出会い水準は▲0.075~▲0.025%近辺の幅広いレンジとなった。ターム物は1W物で▲0.03~▲0.025%の出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T+0(9/3-9/4)は▲0.10~▲0.08%程度、T/N(9/4-9/5)は▲0.105~▲0.09%程度で出会いが見られた。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、5Y134~136、20Y164~165などにビッドが目立った。

### <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2,500億円(前回と同額)でオファーされた。平均落札利回較差+0.004%、按分落札利回較差+0.002%と小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.15~▲0.145%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は鉄鋼、石油・石炭製品、ノンバンク等の業態でまとまった額の調達が見られ、償還総額1,700億円程度に対し、発行総額は2,100億円程度と発行超となった。発行レートは、引続き0%近辺の狭いレンジで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/9/3	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.098	0.115	0.015	22,707.38	▲ 157.77	111.13-14	110.96-98
T/N			0.000				-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.032				-	▲ 0.106						
2W							-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.117						
1M							-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.150	▲ 0.136						
6M							▲ 0.164	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.161	▲ 0.159						
									日付	8/27	8/28	8/29	8/30	8/31
									日銀当預残	3,930,900	3,933,500	3,924,900	3,925,600	3,925,200
									準備預金残	3,434,100	3,434,100	3,427,500	3,423,900	3,444,400
									マネタリーベース	5,025,400	5,028,300	5,019,400	5,020,900	5,020,600
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.051%	▲0.053%	▲0.050%	▲0.055%
									コール市場残高	99,344	98,919	102,474	98,520	103,581
									うち無担	83,251	85,296	86,527	83,988	78,360
									うちO/N	48,851	52,166	53,107	52,518	47,420
									うち有担	16,093	13,623	15,947	14,532	25,221

## ●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)
流動性供給	269	-	6,000	2018/9/4		17,539.0	5,986.00		0.0140%	26.5367%		0.0120%	

## ●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	2,500	2018/9/4			10,376	2,501	0.002		0.004	8.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	38,530	2018/9/3	2018/9/4		387	387		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2018/9/3	2018/9/4		0	0				

## ●2018年9月4日の予定

\*8月実績/9月見込み財政資金対民間収支  
\*8月のマネタリーベース  
\*米国7月の建設支出  
\*米国8月のISM製造業景況指数

◆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