

Central Daily Market Report

2018年9月5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9月5日 需給速報	2018年9月6日 需給予想	2018年9月7日 当社予想
銀行券	900	▲ 100	0
財政	▲ 8,800	▲ 23,300	3,000
資金過不足	▲ 7,900	▲ 23,400	3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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	9,000		
CP等買入		▲ 200	4,500
貸出支援基金(成)			
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	▲ 1,400	900	1,400
当預増減	0	▲ 22,200	7,500
当座預金残高	3,870,000	3,847,800	3,855,300
準備預金残高	3,385,000		
積み終了先	3,384,400		
超過準備	3,384,400		
非準備預金先	485,000		
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	99.91%	日数
			67.74%

●2018年9月5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・証券業態より▲0.086~▲0.055%、地銀業態で▲0.07~▲0.025%の調達希望で始まった。朝方の出合いの水準は横ばい圏の▲0.07~▲0.025%近辺であった。ターム物は引き続き1~2W物で▲0.03%台の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(9/5-9/6)は▲0.10~▲0.08%程度での出合い、T/N(9/6-9/7)は▲0.105~▲0.095%程度での出合い。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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.145%、1Y物が▲0.16%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、卸売業態で1,000億円弱、石油業態で500億円弱等の大型案件がみられたものの、発行総額は2,400億円程度と償還総額2,700億円程度を下回った。発行レートは引続き0%近辺の狭いレンジで推移している。期越案件が少なかったこともあり、昨日のオペレート低下の影響は特段見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/9/5	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	▲ 0.052				-	▲ 0.098	0.110	▲ 0.004	22,580.83	▲ 116.07	111.46-47	111.45-46
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.033	▲ 0.025	▲ 0.028				-	▲ 0.106						
2W	▲ 0.033	▲ 0.025	▲ 0.030				-	▲ 0.110						
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.117						
1M							-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.149	▲ 0.139						
6M							▲ 0.159	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.158						
									日付	8/29	8/30	8/31	9/3	9/4
									日銀当預残	3,924,900	3,925,600	3,925,200	3,894,700	3,870,000
									準備預金残	3,427,500	3,423,900	3,444,400	3,409,000	3,384,500
									マネタリーベース	5,019,400	5,020,900	5,020,600	4,989,300	4,964,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.053%	▲ 0.050%	▲ 0.055%	▲ 0.052%	▲ 0.054%
									コール市場残高	102,474	98,520	103,581	111,773	110,780
									うち無担	86,527	83,988	78,360	84,386	84,736
									うちO/N	53,107	52,518	47,420	53,206	53,216
									うち有担	15,947	14,532	25,221	27,387	26,044

●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)
10年利付国債	351	0.10%	22,000	2018/9/6	2028/6/20	81,053.0	17,822.00	99.8600	0.1140%	57.5664%	99.8700	0.1130%	4,162.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/9/13	2019/3/14	190,771.0	10,500.15		0.0000%	5.5041%		0.0000%	

●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	申込総額(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)	41,000	2018/9/5	2018/9/6		1,333	1,333		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,808	2018/9/5	2018/9/6		75	75		▲ 0.600	▲ 0.600	
米ドル資金供給		2018/9/7	2018/9/13	2.42	1	1				

●2018年9月6日の予定

*片岡日銀審議委員、 神奈川県金融経済懇談会にて講演	*米国7月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国8月のISM非製造業景況指数	*国庫短期証券(781回)入札 (6ヶ月、23,000億円、9/10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