

Central Daily Market Report

2018年9月6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9月6日 需給速報	2018年9月7日 需給予想	2018年9月10日 当社予想
銀行券	▲ 200	600	1,000
財政	▲ 24,300	900	▲ 21,000
資金過不足	▲ 24,500	1,500	▲ 20,000
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			▲ 2,200
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		5,500	
CP等買入	▲ 200	4,500	▲ 600
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 100
ETF買入			
国債補完供給	▲ 400	1,400	400
当預増減	▲ 23,700	11,200	▲ 22,200
当座預金残高	3,846,300	3,857,500	3,835,300
準備預金残高	3,363,000		
積み終了先	3,362,400		9月7日以降の残り所要積立額
超過準備	3,362,400		積数
非準備預金先	483,300		1日平均
			200
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	99.94%	日数
			70.97%

●2018年9月6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。出合いの水準は概ね横ばいの▲0.07~▲0.025%のレンジで、一巡後は一部の業態から取り上がる動きも見られた。ターム物は1~2W物で▲0.03%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(9/6-9/7)は▲0.10~▲0.08%程度での出合い、T/N(9/7-9/10)は▲0.100~▲0.085%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は小幅上昇した。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引においては特段の出合いが見られない中、年末越えの担保需要もあつてか、平均落札利回▲0.1563%、按分落札利回▲0.1502%と堅調な結果となった。セカンダリーでは、▲0.165~▲0.159%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.148%、1Y物が▲0.158%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、償還総額2,700億円程度に対し、発行総額1,100億円程度と償還超となった。発行レートは全体的に横ばい圏で推移しているものの、先日のオペの結果を受けてか、期越案件でレート低下余地を探る動きが見られた。

●短期金融市場関連指標

2018/9/6	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	▲ 0.073	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.098	0.105	▲ 0.005	22,487.94	▲ 92.89	111.45-46	111.31-32
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.033	▲ 0.020	▲ 0.026				-	▲ 0.106						
2W			▲ 0.033				-	▲ 0.111						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.120						
1M							-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.149	▲ 0.139						
6M							▲ 0.160	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.158						
									日付	8/30	8/31	9/3	9/4	9/5
									日銀当預残	3,925,600	3,925,200	3,894,700	3,870,000	3,870,000
									準備預金残	3,423,900	3,444,400	3,409,000	3,384,500	3,385,000
									マネタリーベース	5,020,900	5,020,600	4,989,300	4,964,400	4,963,500
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.055%	▲0.052%	▲0.054%	▲0.052%
									コール市場残高	98,520	103,581	111,773	110,780	112,527
									うち無担	83,988	78,360	84,386	84,736	87,402
									うちO/N	52,518	47,420	53,206	53,216	54,922
									うち有担	14,532	25,221	27,387	26,044	25,125

●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)
国庫短期証券	781	-	23,000	2018/9/10	2019/3/11	86,732.0	18,802.7	100.0750	▲0.1502%	21.0064%	100.0780	▲0.1563%	4,197.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/9/7			1,229	500	0.047		0.057	85.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/9/7			14,138	4,514	▲0.005		▲0.005	75.5
国債買入(物価連動債)	250	2018/9/7			1,274	254	▲0.120		▲0.131	88.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	112,907	2018/9/6	2018/9/7		406	406		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月7日の予定

*7月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比▲0.9%)	*米国8月の雇用統計 *ユーロ圏4-6月期のGDP確報値	*国庫短期証券(782回)入札 (3ヶ月、42,500億円、9/10発行)
*7月の毎月勤労統計調査速報		*流動性供給入札 (4,000億円、9/10発行)
*7月の景気動向指数速報		*エネルギー対策借入 (7,000億円、9/20借入)
*8月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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