

Central Daily Market Report

2018年9月10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10日 需給速報	2018年9月11日 需給予想	2018年9月12日 当社予想
銀行券	600	100	1,000
財政	▲ 20,700	▲ 1,000	▲ 11,000
資金過不足	▲ 20,100	▲ 900	▲ 10,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	1,400	▲ 2,200	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			7,500
国債買入			11,200
CP等買入		▲ 600	▲ 200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入			
E T F 買入			
国債補充供給		200	
当預増減	▲ 21,300	17,600	▲ 10,000
当座預金残高	3,836,100	3,853,700	3,843,700
準備預金残高	3,382,500		
積み終了先	3,382,400		9月11日以降の残り所要積立額
超過準備	3,382,400		積数
非準備預金先	453,600		700
			1日平均
			100
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額			3,098,100
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数
			83.87%

●2018年9月10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▲0.07~▲0.06%、地銀業態で▲0.07~▲0.025%の調達希望が始まった。朝方は▲0.07~▲0.025%の幅広いレンジの出会いが見られたものの、週初様子見の展開となり、一巡後は▲0.08%近辺の出会いも散見された。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T+0(9/10-9/11)は▲0.10~▲0.09%程度での出会い、T/N(9/11-9/12)は▲0.10~▲0.095%程度での出会い。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。アウトライト市場では、短国買入オペが7,500億円(前回比+5,000億円)でオファーされた。引き続き応札額が29,774億円と多く、平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差±0.000%と小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.133~▲0.132%、1Y物が▲0.155%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、償還総額1,300億円程度に対して発行総額1,500億円程度とほぼ変わらずであった。発行レートは引き続き0%近辺での決着が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/9/10	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	▲ 0.054				-	▲ 0.095	0.110	0.005	22,373.09	66.03	110.92-93	110.98-99
T/N			0.000				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.103						
2W							-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.138						
1M							-	▲ 0.133						
3M							▲ 0.130	▲ 0.135						
6M							▲ 0.160	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.158						
									日付	9/3	9/4	9/5	9/6	9/7
									日銀当預残	3,894,700	3,870,000	3,870,000	3,846,300	3,857,400
									準備預金残	3,409,000	3,384,500	3,385,000	3,363,000	3,381,400
									マネタリーベース	4,989,300	4,964,400	4,963,500	4,940,100	4,950,500
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.054%	▲0.052%	▲0.051%	▲0.053%
									コール市場残高	111,773	110,780	112,527	111,188	115,543
									うち無担	84,386	84,736	87,402	86,082	88,797
									うちO/N	53,206	53,216	54,922	54,512	58,327
									うち有担	27,387	26,044	25,125	25,106	26,746

●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
国庫短期証券買入	7,500	2018/9/11			29,774	7,503	0.000		0.002	56.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2018/9/11			9,819	3,012	0.001		0.002	4.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/9/11			13,257	3,507	0.003		0.003	42.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/9/11			14,273	4,509	0.003		0.004	20.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	25,228	2018/9/10	2018/9/11		0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	30,000	2018/9/10	2018/9/11		5	5		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月11日の予定

*8月のマネーストック	*米国7月の卸売売上高	*30年利付国債入札(7,000億円、9/12発行)
*7月の第3次産業活動動数		

◆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