

Central Daily Market Report

2018年9月11日(火)

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11日		2018年9月12日		2018年9月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		600		0	
財政	▲ 2,300		▲ 9,400		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 2,200		▲ 8,800		▲ 1,000	
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						
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		▲ 200		▲ 400		
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			200			
国債補完供給						
当預増減	16,300		▲ 9,000		▲ 1,000	
当座預金残高	3,852,400		3,843,400		3,842,400	
準備預金残高	3,388,100					
積み終了先	3,388,000				9月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,388,000				積数	
非準備預金先	464,300				1日平均	
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	87.10%		

●2018年9月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、メガバンク・都銀・信託・証券業態より▲0.086~▲0.06%、地銀業態から▲0.08~▲0.035%の調達希望で始まった。朝方の出合いは一部取り調整の動きが見られたものの、前日比小幅低下の▲0.08~▲0.035%のレンジとなった。ターム物は1~2W物で▲0.03%台の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(9/11-9/12)は▲0.10~▲0.09%程度での出合い、T/N(9/12-9/13)は▲0.10~▲0.09%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10Y336、340~351、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、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、2,000億円程度の償還に対して、発行は1,000億円程度と償還超であった。発行レートは横ばい圏で推移した。CP等買入オペが事前の予定より500億円増額の5,000億円でオファーされた。結果は按分落札レート▲0.016%、平均落札レート▲0.010%と、前回(按分▲0.007%、平均▲0.004%)比で低下となった。

●短期金融市場関連指標

2018/9/11	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.057				-	▲ 0.095	0.105	▲ 0.005	22,664.69	291.60	111.14-15	111.53-55
T/N			0.000				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.030				-	▲ 0.103						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.138						
1M							-	▲ 0.133						
3M							▲ 0.130	▲ 0.135						
6M							▲ 0.160	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.152	▲ 0.158						
									日付	9/4	9/5	9/6	9/7	9/10
									日銀当預残	3,870,000	3,870,000	3,846,300	3,857,400	3,836,100
									準備預金残	3,384,500	3,385,000	3,363,000	3,381,400	3,382,600
									マネタリーベース	4,964,400	4,963,500	4,940,100	4,950,500	4,928,700
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.052%	▲0.051%	▲0.053%	▲0.054%
									コール市場残高	110,780	112,527	111,188	115,543	111,627
									うち無担	84,736	87,402	86,082	88,797	86,434
									うちO/N	53,216	54,922	54,512	58,327	55,984
									うち有担	26,044	25,125	25,106	26,746	25,193

●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)
30年利付国債	59	0.70%	7,000	2018/9/12	2048/6/20	24,494.0	5,789.00	96.7000	0.8380%	81.5511%	96.7100	0.8380%	1,204.0

●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
CP等買入	5,000	2018/9/14			11,160	5,000	▲0.016		▲0.010	34.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,175	2018/9/11	2018/9/12		1	1		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	23,248	2018/9/11	2018/9/12		6	6		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/9/13	2018/9/20	2.41	1	1				

●2018年9月12日の予定

*7-9月期の法人企業景気予測調査季報

*米国ページブック

*米国8月の生産者物価指数

◆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