

Central Daily Market Report

2018年9月12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12日		2018年9月13日		2018年9月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600	▲ 800	▲ 1,000			
財政	▲ 9,800	2,300	▲ 11,000			
資金過不足	▲ 9,200	1,500	▲ 12,000			
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						
国債買入			7,400			
CP等買入		▲ 400	▲ 200	5,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						▲ 25,900
被災地支援						
社債等買入			▲ 100			
E T F 買入	200					
国債補完供給	▲ 100		100			
当預増減	▲ 9,500	8,700	▲ 32,900			
当座預金残高	3,842,900	3,851,600	3,818,700			
準備預金残高	3,377,000					
積み終了先	3,376,900					
超過準備	3,376,900					
非準備預金先	465,900					
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	90.32%		

●2018年9月12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~▲0.065%、地銀業態から▲0.086~▲0.035%の調達希望で始まった。朝方の出合いは横ばいの▲0.08~▲0.035%の幅広いレンジとなった。ターム物は月内物を中心に▲0.03%前後の出合いが複数見られた。

<レポ市場>

GC T+0(9/12-9/13)は▲0.10~▲0.09%程度での出合い、T/N(9/13-9/14)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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.127%、6M物が▲0.165%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、不動産業態から大型案件が見られ、発行額は2,000億円程度となったものの、償還額は4,000億円程度と償還超のマーケットであった。発行レートは概ね0%近辺での決着であった。

●短期金融市場関連指標

2018/9/12	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	▲ 0.058				-	▲ 0.094	0.105	0.000	22,604.61	▲ 60.08	111.61-63	111.48-49
T/N			0.000				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.033	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.110						
3W			0.000				-	▲ 0.137						
1M							-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.130	▲ 0.135						
6M							▲ 0.160	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.152	▲ 0.158						
									日付	9/5	9/6	9/7	9/10	9/11
									日銀当預残	3,870,000	3,846,300	3,857,400	3,836,100	3,852,400
									準備預金残	3,385,000	3,363,000	3,381,400	3,382,600	3,388,100
									マネタリーベース	4,963,500	4,940,100	4,950,500	4,928,700	4,944,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.052%	▲ 0.051%	▲ 0.053%	▲ 0.054%	▲ 0.057%
									コール市場残高	112,527	111,188	115,543	111,627	118,788
									うち無担	87,402	86,082	88,797	86,434	92,450
									うちO/N	54,922	54,512	58,327	55,984	61,880
									うち有担	25,125	25,106	26,746	25,193	26,338

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/9/13			10,383	4,510	0.005		0.006	27.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/9/13			5,422	1,810	0.004		0.005	13.5
国債買入(残存期間25年超)	600	2018/9/13			1,621	606	0.005		0.006	57.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2018/9/12	2018/9/13		85	85		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/9/12	2018/9/13		5	5		▲ 0.600	▲ 0.600	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2018/9/14	2022/9/14	0	10,663					

●2018年9月13日の予定

*7月の機械受注統計	*米国8月の財政収支	*5年利付国債入札
*8月の企業物価指数	*米国8月の消費物価指数	(20,000億円、9/14発行)
	*ECB定例理事会(金融政策発表)	
	*英中銀MPC結果発表	

◆本資料は信頼できるとさ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