Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●貝並而和							
₩ /± /± m	2018年9	9月14日	2018年9	9月18日	2018年9月19日		
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想		
銀行券		▲ 600		1, 100		1,000	
財政	4	9, 700		11, 200	0		
資金過不足	A	10, 300		12, 300	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			1, 900	1 , 300			
国債買現							
国債売現							
国庫短期証買入							
国債買入			7, 100				
CP等買入	5, 000	▲ 1,300		▲ 900			
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)	10, 700	A 7, 000					
被災地支援							
社債等買入				▲ 200			
ETF買入							
国債補完供給	▲ 300	200		300			
当預増減	1	3,000		19, 200		1, 000	
当座預金残高	3,	847, 100	3,	866, 300	3,	867, 300	
準備預金残高	3,	396, 200					
積み終了先	3,	396, 200		9月18日以	降の残り	听要積立額	
超過準備		396, 200		積数		115, 800	
非準備預金先		450, 900		1日平均	4, 100		
積み期間(9/16~	10/15)	の所要準	備額		2,	987, 900	
準備預金進捗率	実績		96. 12%	日数		6.67%	

●2018年9月14日の市場動向

〈インターパンク市場〉

本日の無担O/N物は、実質的な積み最終日となったが、連休を控え動意の 乏しい展開となった。朝方の出合いは都銀・信託・地銀・証券業態から▲ 0.086~▲0.035%での調達が見られ、前日比横ばい圏で推移。一巡後は一 部の地銀から調整の動きも見られた。ターム物は引き続き月内物を中心に ▲0.03%近辺の出合いが散見された。

〈レポ市場〉

GC T+0(9/14-9/18)は▲0.10~▲0.09%程度での出合い、T/N(9/18-9/19) 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10Y336、340~351、5Y134~135、 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、3M物の入札 が実施された。WI取引において▲0.125~▲0.123%での出合いが見られる 中、平均落札利回▲0.1244%、按分落札利回▲0.1196%と前回債からレー は上昇したものの、概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは、▲ 0.13~▲0.125%の出合いと堅調に推移した。

〈CP市場〉

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は案件少なく、1,200億円 程度の償還に対して発行は200億円程度と閑散であった。発行レートは概ね 0%近辺での決着であった。

JGB新発10年債

●短期金融市場関連指標

2018/9/14	無担 (連報)				有担 (速報)	短国	東京 レポレート	
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計值	平均值
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.093
T/N			0.000				-	▲ 0.106
S/N							-	-
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.112
2W							-	▲ 0.132
3W							-	▲ 0.132
1 M							-	▲ 0.132
3M							▲ 0.129	▲ 0.135
6M							▲ 0.161	▲ 0.146
1Y							▲ 0.148	▲ 0.158

ではお新りたけの十段				口框上与外面				1 707 1 3			
直边	丘値	前	日比	15	15時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)	
0.1	05	0.0	000	23	23,094.67		273.35		112.03-04	111.82-84	
	日付		9/	7 9/10			9/11		9/12	9/13	
日銀当	日銀当預残		3,857,400		3,836,100		3,852,400		3,842,900	3,850,100	
準備預	準備預金残		3,381,400		3,382,600		3,388,100		3,377,000	3,383,000	
マネタリーベース		一 ス	4,950,500		4,928,700		4,944,800		4,934,700	4,942,800	
無担O	無担O/N加重平均		▲0.0	53%	▲0.05	▲0.054%		7%	▲0.058%	▲0.058%	
コール	コール市場残高		115,543		111,627		118,788		116,083	109,338	
	うち無担		88,	8,797 86,4		34	92,450		89,293	83,354	
	5	50/N	58,327		55,9	55,984		30	59,073	53,964	
うち有担		26,	746	25,1	93	26,33	38	26,790	25,984		

日経平均株価

ドル/円

●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	東分率	募入 平均価格	募入平均利回·利 回較差	第 I 非価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	783	-	43,000	2018/9/18	2018/12/17	176,849.0	35,265.5	100.0295	▲0.1196%	25.6170%	100.0307	▲0.1244%	7,734.0

●オペ結果

稚類	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
共通担保資金供給(全店) < 固定金利方式 >	8,000	2018/9/18	2018/10/1		1,881	1,881				
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/9/18			1,396	500	0.159		0.165	96.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2018/9/18			9,332	3,012	0.002		0.003	53.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/9/18			13,748	3,508	0.002		0.003	14.6
社債等買入	1,000	2018/9/21			2,640	1,000	▲0.044		▲0.018	9.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	84,055	2018/9/14	2018/9/18		207	207		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	21,175	2018/9/14	2018/9/18		6	6		▲0.600	▲0.600	
潜籍		7.4-LB	エンドロ	貸付	貸付	定総額		-		

(億円) 被災地金融支援オペ 807 第89[2018/9/2 2019/9/20 被災地金融支援オペ(能本) 笙28回 2018/9/21 2019/9/20

●2018年9月17日の予定

*敬老の日

*ユーロ圏8月の消費者物価指数改訂値

●2018年9月18日の予定

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、19日まで)
- *7月の石油消費動態統計

*国庫短期証券(784回)入札 (1年、21,000億円、9/20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。
- ◆本資料は何ら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論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