

Central Daily Market Report

2018年9月14日(金)

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14日 需給速報	2018年9月18日 需給予想	2018年9月19日 当社予想
銀行券	▲ 600	1,100	1,000
財政	▲ 9,700	11,200	0
資金過不足	▲ 10,300	12,300	1,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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	▲ 7,000	
被災地支援			
社債等買入			▲ 200
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 300	200	300
当預増減	▲ 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日以降の残リ所要積立額
超過準備	3,396,200		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%

●短期金融市場関連指標

2018/9/14	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.093	0.105	0.000	23,094.67	273.35	112.03-04	111.82-84
T/N			0.000				-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.112						
2W							-	▲ 0.132						
3W							-	▲ 0.132						
1M							-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.129	▲ 0.135						
6M							▲ 0.161	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.158						
									日付	9/7	9/10	9/11	9/12	9/13
									日銀当預残	3,857,400	3,836,100	3,852,400	3,842,900	3,850,100
									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	4,950,500	4,928,700	4,944,800	4,934,700	4,942,800
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.054%	▲0.057%	▲0.058%	▲0.058%
									コール市場残高	115,543	111,627	118,788	116,083	109,338
									うち無担	88,797	86,434	92,450	89,293	83,354
									うちO/N	58,327	55,984	61,880	59,073	53,964
									うち有担	26,746	25,193	26,338	26,790	25,984

●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	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

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
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	
種類		スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)					
被災地金融支援オペ		第89回	2018/9/21	2019/9/20	0	807				
被災地金融支援オペ(熊本)		第28回	2018/9/21	2019/9/20	0	0				

●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)	*国庫短期証券(784回)入札 (1年、21,000億円、9/20発行)
*7月の石油消費動態統計	

◆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