

Central Daily Market Report

2018年9月21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21日 需給速報	2018年9月25日 需給予想	2018年9月26日 当社予想
銀行券	▲ 700	300	▲ 1,000
財政	▲ 900	4,600	0
資金過不足	▲ 1,600	4,900	▲ 1,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,100	▲ 1,400
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	5,000		
国債買入		8,700	
CP等買入		▲ 700	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援	800	▲ 800	
社債等買入	1,000		
E T F 買入	300	200	
国債補充供給	▲ 1,600	1,000	1,600
当預増減	3,200	15,400	▲ 1,000
当座預金残高	3,946,000	3,961,400	3,960,400
準備預金残高	3,456,000		
積み終了先	3,453,500	9月25日以降の残リ所要積立額	
超過準備	3,452,600	積数	13,900
非準備預金先	490,000	1日平均	700
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	99.53%	日数
			30.00%

●2018年9月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは地銀業態で▲0.07~▲0.03%、都銀・信託・証券・外銀業態で▲0.085~▲0.07%の出合いが見られた。前日に比べ調達ニーズがやや強まったが、一巡後は散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は月内物のショートタームで▲0.03%前後の出合いが見られた。共通担保資金供給オペアは、8,000億円(9/25~10/9)オファーされ、応札額2,142億円(期落ち分1,363億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(9/21-9/25)は、▲0.12~▲0.095%程度の出合い。T/N(9/25-9/26)は、▲0.115~▲0.10%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。10Y339~351、5Y130~136などにビッドの出入りが目立った。

<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。今回の入札は償還日が海外の休日にあたり、レートの上昇も予想された。WI取引において▲0.12%から▲0.11%にレートが上昇する中、平均落札利回▲0.1142%、按分落札利回▲0.1082%とWI取引を反映し、前回債から上昇する結果となった。セカンダリーでは、▲0.115%から出合い、引けにかけて▲0.145%まで買い進まれ、強含みで推移した。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は鉄鋼・ノンバンク業態から大型発行も見られたが、償還総額3,000億円強に対して、発行総額1,400億円程度にとどまり、引き続き償還超となった。発行レートに目立った変化はなかったが、一部期越え案件では積極的な買いが見られたものもあった。

●短期金融市場関連指標

2018/9/21	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.100	0.125	0.010	23,869.93	195.00	112.49-51	112.70-71
T/N			0.000				-	▲ 0.112						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.025	▲ 0.031				-	▲ 0.130						
2W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.017				-	▲ 0.126						
3W							-	▲ 0.126						
1M							-	▲ 0.127						
3M			0.070				▲ 0.139	▲ 0.132						
6M							▲ 0.156	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.154						
									日付	9/13	9/14	9/18	9/19	9/20
									日銀当預残	3,850,100	3,847,100	3,865,100	3,872,100	3,942,800
									準備預金残	3,383,000	3,396,200	3,388,800	3,394,000	3,446,800
									マネタリーベース	4,942,800	4,940,500	4,957,400	4,964,100	5,035,800
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.062%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.064%
									コール市場残高	109,338	107,732	113,506	102,017	112,261
									うち無担	83,354	81,468	87,033	81,913	86,960
									うちO/N	53,964	52,548	55,843	50,773	51,540
									うち有担	25,984	26,264	26,473	20,104	25,301

●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	785	-	42,700	2018/9/25	2018/12/25	157,826.0	35,061.7	100.0270	▲0.1082%	78.6151%	100.0285	▲0.1142%	7,638.0

●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	2018/9/25	2018/10/9		2,142	2,142				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2018/9/25			8,082	3,003	0.001		0.003	23.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/9/25			8,533	3,506	0.003		0.004	35.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/9/25			5,690	1,802	0.021		0.025	15.7
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/9/25			2,208	502	0.038		0.040	80.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	108,230	2018/9/21	2018/9/25		1,486	1,486		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月25日の予定

*黒田日銀総裁、大阪経済4団体共催懇談会にて講演	*米国FOMC(1日目)
*金融政策決定会合議事要旨(7月30、31日開催分)	*米国7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*7月の景気動向指数改訂状況	*米国9月のCB消費者信頼感指数
*8月の企業向けサービス価格指数	

◆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