

Central Daily Market Report

2018年9月26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26日		2018年9月27日		2018年9月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 1,100		▲ 700	
財政	▲ 3,100		▲ 10,500		3,200	
資金過不足	▲ 3,100		▲ 11,600		2,500	
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	2,500					
国債買入	4,800					
CP等買入		▲ 600		▲ 1,200	5,000	
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	600		100			
国債補完供給	▲ 2,500	500		2,500		
当預増減	2,200		▲ 10,200		7,500	
当座預金残高	3,960,200		3,950,000		3,957,500	
準備預金残高	3,472,900					
積み終了先	3,471,900		9月27日以降の残り所要積立額		積数 9,800	
超過準備	3,471,200		1日平均		500	
非準備預金先	487,300					
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	99.67%	日数	36.67%		

●2018年9月26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▲0.08~▲0.035%、都銀・信託・証券・外銀業態で▲0.08~▲0.07%の出合いが見られた。朝方は▲0.07%台中心の出合いと前日と比べ概ね横ばいの動きであった。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(9/26-9/27)は、▲0.11~▲0.09%程度の出合い。T/N(9/27-9/28)は、▲0.115~▲0.105%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T/Nは横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.145~▲0.143%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は、2営業日後が半期末にあたるため、不動産・ゴム等の業態からは大型発行も見られたが、3兆5,000億円弱の償還総額に対して、入札ベースの発行総額は、前倒し発行分も含め7,100億円程度にとどまる大幅な償還超となった。発行レートについては、目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/9/26	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.099	0.120	▲ 0.005	24,033.79	93.53	112.97-99	112.85-86
T/N			0.000				-	▲ 0.109						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.130						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.125						
3W							-	▲ 0.125						
1M			0.002				-	▲ 0.127						
3M							▲ 0.135	▲ 0.132						
6M							▲ 0.150	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.143	▲ 0.154						
									日付	9/18	9/19	9/20	9/21	9/25
									日銀当預残	3,865,100	3,872,100	3,942,800	3,946,000	3,958,000
									準備預金残	3,388,800	3,394,000	3,446,800	3,456,000	3,470,300
									マネタリーベース	4,957,400	4,964,100	5,035,800	5,039,600	5,051,400
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%
									コール市場残高	113,506	102,017	112,261	119,408	114,922
									うち無担	87,033	81,913	86,960	96,069	93,236
									うちO/N	55,843	50,773	51,540	59,339	55,476
									うち有担	26,473	20,104	25,301	23,339	21,686

●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)
40年利付国債	11	0.80%	4,000	2018/9/27	2058/3/20	12,917.0	3,992.00		1.0250%	66.5584%			

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	185,867	2018/9/26	2018/9/27		2,388	2,388		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月27日の予定

*黒田日銀総裁、全国証券大会にて講演

*米国4-6月期のGDP確報値

*米国8月の米耐久財新規受注

◆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