# Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●貨金需和								
¥ /4 /* F	2018年9	月27日	2018年9	9月28日	2018年10月1日			
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想			
銀行券		<b>▲</b> 900		▲ 600		1,000		
財政	•	11,000		2, 200	<b>A</b>	23, 000		
資金過不足	<b>A</b>	11, 900		1, 600	<b>A</b>	22, 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						<b>1</b> , 900		
国債買現								
国債売現								
国庫短期証買入								
国債買入			9, 200					
CP等買入		<b>▲</b> 1, 200	5, 000	<b>▲</b> 4,800				
貸出支援基金(成)								
貸出支援基金(貸)								
被災地支援								
社債等買入								
ETF買入	100		1,000					
国債補完供給	<b>▲</b> 1,800	2, 500		1, 800				
当預増減	<b>A</b>	12, 300		13, 800	<b>A</b>	23, 900		
当 <u>座預金残高</u>		947, 900	3,	961, 700	3, 937, 800			
準 <u>備預金残高</u>		462, 800						
積み終了先		462, 000			降の残り	<b>听要積立額</b>		
超過準備		462, 000		積数		9, 000		
非準備預金先		485, 100		1日平均	500			
積み期間(9/16~	10/15) (	の所要準	備額		2, 988, 300			
準備預金進捗率	実績		99. 70%	日数		40.00%		

#### ●2018年9月27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~▲0.035%、信託·証券·外銀業態で ▲0.085~▲0.065%の出合いが見られた。前日と比べ概ね横ばいの動きと なった。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(9/27-9/28)は、▲0.105~▲0.095%程度の出合い。T/N(9/28-10/1)は、▲0.20~▲0.12%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は月末初に該当し、低下した。アウトライト市場は、売り物の ない中、1Y物で▲0.15~▲0.145%と強めの出合いが見られた。

#### 〈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営業日後が期初に あたり、商社・機械・鉄鋼等の幅広い業態が大ロットでの発行を実施したた め、償還が見られなかった一方で、発行総額は9,400億円程度にまで膨らん だ。発行レートは概ね0%近辺での決着が中心となり、目立った変化は見ら れなかった。

### ●短期金融市場関連指標

2018/9/27		無担(速報)		有担 (速報)		短国	東京 レポレート	JGB新発1	0年債	目 日経平均核		株価	
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	充實参考統計值	平均値	直近値	前日比	15	時時点	前日比
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.098	0.115	▲ 0.005	23,	796.74	237.0
T/N							-	▲ 0.143	日付	9/1		9/20	9/2
S/N							-	-	日銀当預残		-	3.942.800	-
1W	▲ 0.036	▲ 0.035	▲ 0.035				_	▲ 0.127	上		_	· ·	<u> </u>
2W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.023				_	▲ 0.123			_	3,446,800	
	_ 0.000	■ 0.000	- 0.020						マネタリーベース	4,964	,100	5,035,800	5,039
3W							-	▲ 0.122	無担O/N加重平	均 ▲0.0	64%	▲0.064%	▲0.0
1M							-	▲ 0.125	コール市場残高	102	,017	112,261	119
3M							▲ 0.135	▲ 0.132	うち無担	81,	,913	86,960	96
6M							▲ 0.150	▲ 0.145	うちの	D/N 50	,773	51,540	59
1Y							▲ 0.147	▲ 0.155	うち有担	20.	,104	25,301	23

J	GB新	発10年	- 慎	日経平均株価					トル/円				
直近値 前日			日比	15	時時点	Ī	前日比		為替(9時)	為替(17時)			
0.	115	<b>A</b> (	0.005	23	3,796.74	•	237.05		112.71-72	112.60-61			
日付			9/1	9 9/20			9/21		9/25	9/26			
日銀当	日銀当預残			100	00 3,942,80		3,946,000		3,958,000	3,960,200			
準備剂	準備預金残			000	3,446,8	00	3,456,000		3,470,300	3,472,900			
マネタ	·/_^	ベース	4,964,100		5,035,800		5,039,600		5,051,400	5,053,800			
無担C	)/N加	重平均	▲0.064%		▲0.064%		▲0.063%		▲0.062%	▲0.062%			
コール	市場	残高	102,017		112,261		119,408		114,922	118,212			
	うち無担			81,913		86,960		36	93,236	95,124			
	うち0/N		50,	773	51,5	40	59,33	39	55,476	57,254			
	うち有	担	20,104		25,301		23,339		21,686	23,088			

#### ●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 I 非価格 競争入札(億円)

#### ●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	応礼総額 (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1年超3年以下)	3,000	2018/9/28			8,156	3,008	▲0.003		▲0.002	98.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/9/28			8,442	3,502	▲0.005		▲0.004	74.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/9/28			4,840	1,811	▲0.010		▲0.009	97.6
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/9/28			1,710	501	▲0.011		▲0.010	89.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	72,894	2018/9/27	2018/9/28		1,123	1,123		▲0.600	▲0.600	i
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	48.330	2018/9/27	2018/9/28		604	604		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年9月28日の予定

- \*決定会合における主な意見(9月18、19日分)
- \*9月の都区部消費者物価指数(CPI)
- 市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.9%
- \*8月の完全失業率(市場予想:2.5%)
- \*8月の有効求人倍率(市場予想:1.63倍)
- \*8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報
- 市場予想:前月比1.5%
- \*8月の商業動態統計速報 \*8月の住宅着工統計
- \*米国8月の個人所得・消費支出
- \*米国9月のシカゴPM景況感指数
- \*ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値
- \*英国4-6月期のGDP確報値
- \*国庫短期証券(786回)入札
- (3ヶ月、43,000億円、10/1発行)
- \*2年利付国債入札
- (21,000億円、10/1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