

Central Daily Market Report

2018年9月28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28日		2018年10月1日		2018年10月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		1,000		0	
財政	▲ 800		▲ 29,300		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 1,400		▲ 28,300		▲ 6,000	
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	▲ 1,900		
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	5,000	▲ 4,800		▲ 100		
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	1,000					
国債補完供給	▲ 2,900	1,800		2,900		
当預増減	7,900		▲ 25,500		▲ 6,000	
当座預金残高	3,955,800		3,930,300		3,924,300	
準備預金残高	3,469,000					
積み終了先	3,468,100		10月1日以降の残り所要積立額		積数 3,300	
超過準備	3,467,100		1日平均		200	
非準備預金先	486,800					
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					2,992,200	
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	50.00%		

●2018年9月28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~▲0.04%、都銀・証券業態で▲0.086~▲0.085%の出合いが見られた。半期末のため調達を控える先が多くレートは低下、運用サイドの出し残りが目立つ地合いとなった。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。共通担保資金供給オペは、8,000億円(10/1~10/15)オファーされ、応札額1,891億円(期落ち分1,881億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(9/28-10/1)は、▲0.25%程度の出合い。T/N(10/1-10/2)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は上昇した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施されたが、償還日が年末越えとなり、WI取引において▲0.21~▲0.18%での強い出合いが見られる中、平均落札利回▲0.2031%、按分落札利回▲0.1860%と、WI取引を反映してレートが前回比で大幅に低下する結果となった。セカンダリーでは、▲0.238~▲0.225%出合いと強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.168~▲0.15%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、償還がなかったものの、商社・小売業態等からまとまったロットでの発行が見られ、発行総額2,200億円程度に膨らんだ。発行レートは引き続き0%付近での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2018/9/28	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.169	0.120	0.005	24,120.04	323.30	113.39-40	113.43-44
T/N							-	▲ 0.114						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.112						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.035	0.010	▲ 0.009				-	▲ 0.126						
3M							▲ 0.232	▲ 0.140						
6M							▲ 0.150	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.155						
									日付	9/20	9/21	9/25	9/26	9/27
									日銀当預残	3,942,800	3,946,000	3,958,000	3,960,200	3,947,900
									準備預金残	3,446,800	3,456,000	3,470,300	3,472,900	3,462,800
									マネタリーベース	5,035,800	5,039,600	5,051,400	5,053,800	5,042,400
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.062%	▲0.060%
									コール市場残高	112,261	119,408	114,922	118,212	123,029
									うち無担	86,960	96,069	93,236	95,124	94,437
									うちO/N	51,540	59,339	55,476	57,254	56,762
									うち有担	25,301	23,339	21,686	23,088	28,592

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	786	-	43,000	2018/10/1	2019/1/9	181,417.0	35,080.5	100.0510	▲0.1860%	11.3663%	100.0557	▲0.2031%	7,919.0
2年利付国債	393	0.10%	21,000	2018/10/1	2020/10/1	76,115.0	17,403.0	100.4200	▲0.1090%	10.5279%	100.4250	▲0.1120%	3,590.0

●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	2018/10/1	2018/10/15		1,891	1,891				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	122,490	2018/9/28	2018/10/1		2,776	2,776		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	48,311	2018/9/28	2018/10/1		62	62		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月1日の予定

*9月調査の日銀短観(概要及び要旨)

市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+22

*米国8月の建設支出

*米国9月のISM製造業景況指数

◆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