Central Daily Market Report

2018年9月7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7日 需給速報		2018年9月10日 需給予想		2018年9月11日 当社予想	
銀行券	600		400		1,000	
財政	1,000		▲ 22,600		▲ 1,000	
資金過不足	1,600		▲ 22,200		0	
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			1,400	▲ 2,200		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,500					
CP等買入	4,500	▲ 600		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 200	400		200		
当預増減	11,100		▲ 23,400		0	

当座預金残高	3,857,400	3,834,000	3,834,000
準備預金残高	3,381,400		
積み終了先	3,381,200	9月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,381,000	積数	800
非準備預金先	476,000	1日平均	100
積み期間（8/16～9/15）の所要準備額			3,098,100
準備預金進捗率	実績 99.97%	日数	80.65%

●2018年9月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態より▲0.07～▲0.06%、地銀業態で▲0.07～▲0.025%の調達希望で始まった。週末ながら取り上がりの動きは見られず、出合いの水準は概ね横ばいの▲0.07%～▲0.025%の出合いとなった。ターム物は引き続き1～2W物で▲0.03%台の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(9/7-9/10)は▲0.10～▲0.08%程度での出合い、T/N(9/10-9/11)は▲0.095～▲0.085%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。個別銘柄では10Y340～351、5Y134～136、20Y164～165などにビッドが目立った。

<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。WI取引においては特段の出合いが見られない中、足元ファンディングレートの上昇や、一時に比べて3M物の需要が落ち着いていることもあってか、平均落札利回▲0.1391%、按分落札利回▲0.1323%と前回債からレートが上昇する結果となった。セカンダリーでは、▲0.13%出合いと小甘く推移した。この他に、6M物が▲0.16%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、海運業態、ノンバンク業態で比較的まとまった額の発行がみられたものの、案件数は膨らまず、発行総額は850億円程度と償還総額1,500億円程度を下回った。発行レートは引続き0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/9/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.053				－	▲ 0.092
T/N			0.000				－	▲ 0.094
S/N							－	－
1W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.023				－	▲ 0.102
2W			▲ 0.033				－	▲ 0.108
3W							－	▲ 0.137
1M							－	▲ 0.136
3M							▲ 0.130	▲ 0.138
6M							▲ 0.160	▲ 0.149
1Y							▲ 0.155	▲ 0.158

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.105	0.000	22,307.06	▲ 180.88	110.49-50	110.74-75

日付	8/31	9/3	9/4	9/5	9/6
日銀当預残	3,925,200	3,894,700	3,870,000	3,870,000	3,846,300
準備預金残	3,444,400	3,409,000	3,384,500	3,385,000	3,363,000
マネタリーベース	5,020,600	4,989,300	4,964,400	4,963,500	4,940,100
無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.052%	▲0.054%	▲0.052%	▲0.051%
コール市場残高	103,581	111,773	110,780	112,527	111,188
うち無担	78,360	84,386	84,736	87,402	86,082
うちO/N	47,420	53,206	53,216	54,922	54,512
うち有担	25,221	27,387	26,044	25,125	25,106

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	782	－	42,500	2018/9/10	2018/12/10	150,047.0	35,017.0	100.0330	▲0.1323%	27.3796%	100.0347	▲0.1391%	7,482.0
流動性供給	270	－	4,000	2018/9/10		18,925.0	3,990.0		▲0.0050%	50.7853%		▲0.0060%	
エネルギー対策	－	－	7,000	2018/9/20	2019/9/20	113,982.0	6,999.86		0.0000%	6.2064%		0.0000%	

●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	2018/9/10	2018/9/25		1,363	1,363				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	95,636	2018/9/7	2018/9/10		173	173		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	19,900	2018/9/7	2018/9/10		6	6		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月10日の予定

*4-6月期のGDP2次速報（市場予想：前期比年率＋2.6%）
*7月の国際収支　*7月の特定サービス産業動態統計速報
*8月の景気ウォッチャー調査
*米国7月の消費者信用残高

◆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