

# Central Daily Market Report

2018年9月13日(木)

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13日		2018年9月14日		2018年9月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 700		1,000	
財政	1,000		▲ 8,700		12,000	
資金過不足	200		▲ 9,400		13,000	
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						▲ 1,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,400					
CP等買入		▲ 200	5,000	▲ 1,300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			10,700	▲ 7,000		
被災地支援社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	7,200		▲ 1,800		11,700	
当座預金残高	3,850,100		3,848,300		3,860,000	
準備預金残高	3,383,000					
積み終了先	3,383,000				9月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,382,600				積数	
非準備預金先	467,100				1日平均	
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	100.00%	日数	93.55%		

## ●2018年9月13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▲0.086~▲0.065%、地銀業態から▲0.086~▲0.035%の調達希望で始まった。一部業態では積み最終日に向け、取り調整の動きが見られたものの、朝方の出合いは▲0.086~▲0.030%と小幅低下となった。ターム物は引き続き月内物で▲0.03%前後の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(9/13-9/14)は▲0.10~▲0.09%程度での出合い、T/N(9/14-9/18)は▲0.11~▲0.095%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10Y336、340~351、5Y134~135、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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.163%で少額出合った程度であった。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、鉄鋼、電機、ゴム業態から大型案件が見られ、発行額は3,300億円程度まで膨らんだものの、償還額と同程度であった(償還額3,500億円程度)。発行レートは概ね0%近辺での決着であった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/9/13	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.059				-	▲ 0.094	0.105	0.000	22,821.32	216.71	111.21-22	111.47-48
T/N			0.000				-	▲ 0.117						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.230	▲ 0.007				-	▲ 0.113						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.137						
1M							-	▲ 0.134						
3M							▲ 0.130	▲ 0.135						
6M							▲ 0.161	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.158						
									日付	9/6	9/7	9/10	9/11	9/12
									日銀当預残	3,846,300	3,857,400	3,836,100	3,852,400	3,842,900
									準備預金残	3,363,000	3,381,400	3,382,600	3,388,100	3,377,000
									マネタリーベース	4,940,100	4,950,500	4,928,700	4,944,800	4,934,700
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.053%	▲0.054%	▲0.057%	▲0.058%
									コール市場残高	111,188	115,543	111,627	118,788	116,083
									うち無担	86,082	88,797	86,434	92,450	89,293
									うちO/N	54,512	58,327	55,984	61,880	59,073
									うち有担	25,106	26,746	25,193	26,338	26,790

## ●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)
5年利付国債	136	0.10%	20,000	2018/9/14	2023/6/20	90,603.0	16,371.00	100.8100	▲0.0690%	10.5496%	100.8200	▲0.0710%	3,619.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	102,541	2018/9/13	2018/9/14		215	215		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年9月14日の予定

\*米国7月の企業在庫  
\*米国8月の小売売上高  
\*米国8月の鉱工業生産・設備稼働率  
\*米国9月のシガン大消費者信頼感指数速報

\*国庫短期証券(783回)入札  
(3ヶ月、43,000億円、9/18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