

# Central Daily Market Report

2018年10月1日(月)  
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10月1日		2018年10月2日		2018年10月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		100		0	
財政	▲ 24,400		▲ 13,400		▲ 53,000	
資金過不足	▲ 23,400		▲ 13,300		▲ 53,000	
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						
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
国債補完供給	▲ 3,700	2,900		3,700		
当預増減	▲ 24,300		▲ 9,700		▲ 53,000	
当座預金残高	3,931,500		3,921,800		3,868,800	
準備預金残高	3,442,900					
積み終了先	3,442,100		10月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,442,100		積数		2,500	
非準備預金先	488,600		1日平均		200	
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	99.92%	日数	53.33%		

## ●2018年10月1日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は邦銀を中心に▲0.085~▲0.03%での調達で始まった。四半期末要因が剥落し、ビッドサイドの調達量は回復したものの、レート水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は▲0.08%近辺での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.03%近辺の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(10/1-10/2)は、▲0.095~▲0.090%程度の出合い。T/N(10/2-10/3)は、▲0.105~▲0.100%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は横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、閑散な中、3M物で▲0.275~▲0.25%での強めの出合いが見られた。

### <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、案件少なく閑散であったが、卸売業態から大型案件が見られ発行総額は1,000億円程度であった(償還総額200億円程度)。発行レートは引き続き0%近辺での決着であった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/10/1	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.095	0.125	0.005	24,245.76	125.72	113.79-80	114.03-04
T/N			0.000				-	▲ 0.103						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.030				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.111						
3W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.021				-	▲ 0.116						
1M	▲ 0.030	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.124						
3M							▲ 0.260	▲ 0.141						
6M							▲ 0.150	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.166	▲ 0.156						
									日付	9/21	9/25	9/26	9/27	9/28
									日銀当預残	3,946,000	3,958,000	3,960,200	3,947,900	3,955,800
									準備預金残	3,456,000	3,470,300	3,472,900	3,462,800	3,469,000
									マネタリーベース	5,039,600	5,051,400	5,053,800	5,042,400	5,050,900
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.062%	▲0.062%	▲0.060%	▲0.064%
									コール市場残高	119,408	114,922	118,212	123,029	64,453
									うち無担	96,069	93,236	95,124	94,437	54,181
									うちO/N	59,339	55,476	57,254	56,762	31,241
									うち有担	23,339	21,686	23,088	28,592	10,272

## ●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1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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)	114,109	2018/10/1	2018/10/2		3,497	3,497		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	44,003	2018/10/1	2018/10/2		66	66		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年10月2日の予定

*9月実績/10月見込み財政資金対民間収支	*10年利付国債入札(22,000億円、10/3発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、10/11借入)
*9月のマネタリーベース		
*9月の消費動向調査		

◆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