

Central Daily Market Report

2018年10月2日(火)

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2日		2018年10月3日		2018年10月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		300		▲ 1,000	
財政	▲ 10,800		▲ 60,500		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 10,700		▲ 60,200		▲ 5,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
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	▲ 1,700	3,700		1,700		
当預増減	▲ 8,800		▲ 57,600		▲ 5,000	
当座預金残高	3,922,700		3,865,100		3,860,100	
準備預金残高	3,430,400					
積み終了先	3,430,200				10月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,429,900				積数	
非準備預金先	492,300				1日平均	
					100	
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	99.94%	日数	56.67%		

●2018年10月2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。引き続きレート水準に変化はなく、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(10/2-10/3)は、▲0.100~▲0.095%程度の出合い。T/N(10/3-10/4)は、▲0.105~▲0.090%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、短国買入オペアがレートが低水準で推移している事が考慮されてか、1,000億円(前回比▲1,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.005%、按分落札利回較差+0.004%と小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.28~▲0.27%、1Y物が▲0.169~▲0.1625%で出合った。

<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、卸売業態から大型案件が見られ発行総額は1,600億円程度であった(償還総額100億円程度)。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

2018/10/2	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	▲ 0.062				-	▲ 0.098	0.135	0.010	24,270.62	24.86	113.94-96	113.81-83
T/N			0.000				-	▲ 0.104						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.116						
1M	▲ 0.028	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.265	▲ 0.142						
6M							▲ 0.150	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.157						
									日付	9/25	9/26	9/27	9/28	10/1
									日銀当預残	3,958,000	3,960,200	3,947,900	3,955,800	3,931,500
									準備預金残	3,470,300	3,472,900	3,462,800	3,469,000	3,442,900
									マネタリーベース	5,051,400	5,053,800	5,042,400	5,050,900	5,025,600
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.062%	▲0.060%	▲0.064%	▲0.063%
									コール市場残高	114,922	118,212	123,029	64,453	111,389
									うち無担	93,236	95,124	94,437	54,181	83,422
									うちO/N	55,476	57,254	56,762	31,241	52,602
									うち有担	21,686	23,088	28,592	10,272	27,967

●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)
10年利付国債	352	0.10%	22,000	2018/10/3	2028/9/20	74,604.0	17,726.00	99.5800	0.1420%	47.4678%	99.5900	0.1410%	4,250.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/10/11	2019/4/12	228,523.0	10,500.02		0.0000%	4.5948%		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
国庫短期証券買入	1,000	2018/10/3			6,132	1,001	0.004		0.005	46.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	99,083	2018/10/2	2018/10/3		1,694	1,694		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	17,047	2018/10/2	2018/10/3		0	0				
米ドル資金供給		2018/10/4	2018/10/12	2.68	0	0				

●2018年10月3日の予定

*10月の日銀当座預金増減要因見込み

*米国9月のISM非製造業景況指数

◆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