

Central Daily Market Report

2018年10月3日(水)
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3日		2018年10月4日		2018年10月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 60,000		800		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 59,700		0		▲ 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			11,000			
CP等買入		▲ 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	▲ 2,500	1,700		2,500		
当預増減	▲ 59,600		13,500		▲ 5,000	
当座預金残高	3,863,100		3,876,600		3,871,600	
準備預金残高	3,380,600					
積み終了先	3,380,500		10月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,380,400		積数		1,700	
非準備預金先	482,500		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	60.00%		

●2018年10月3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。税揚げ要因により大幅な不足日であったものの、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%近辺での出会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%近辺の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(10/3-10/4)は、▲0.095~▲0.085%程度での出会い。T/N(10/4-10/5)は、▲0.110~▲0.095%程度での出会い。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は小幅低下した。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、引け前に1Y物で▲0.17~▲0.165%での出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額800億円程度に対して、発行総額は2,200億円程度と発行超であった。5・10日発行となり石油・鉄鋼等の業態において大型案件が見られ、月の初旬としては比較的活況なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/10/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.060				-	▲ 0.096	0.135	0.000	24,110.96	▲ 159.66	113.56-57	113.87-89
T/N			0.000				-	▲ 0.103						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.028	▲ 0.029				-	▲ 0.106						
2W			▲ 0.028				-	▲ 0.109						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.276	▲ 0.143						
6M							▲ 0.150	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.156						
									日付	9/26	9/27	9/28	10/1	10/2
									日銀当預残	3,960,200	3,947,900	3,955,800	3,931,500	3,922,700
									準備預金残	3,472,900	3,462,800	3,469,000	3,442,900	3,430,400
									マネタリーベース	5,053,800	5,042,400	5,050,900	5,025,600	5,016,700
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.060%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%
									コール市場残高	118,212	123,029	64,453	111,389	114,834
									うち無担	95,124	94,437	54,181	83,422	88,736
									うちO/N	57,254	56,762	31,241	52,602	56,771
									うち有担	23,088	28,592	10,272	27,967	26,098

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2018/10/4			11,886	3,008	0.002		0.002	45.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/10/4			10,836	3,506	0.001		0.001	49.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/10/4			14,272	4,507	0.001		0.002	2.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	125,472	2018/10/3	2018/10/4		2,412	2,412		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	30,000	2018/10/3	2018/10/4		2	2		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月4日の予定

*米国8月の製造業新規受注・出荷・在庫	*流動性供給入札(5,000億円、10/5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