

Central Daily Market Report

2018年10月4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10月4日 需給速報	2018年10月5日 需給予想	2018年10月9日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 400	1,000			
財政	900	▲ 6,200	▲ 3,000			
資金過不足	0	▲ 6,600	▲ 2,000			
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						▲ 2,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	11,000					
CP等買入			▲ 200			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 2,200	2,500	2,200			
当預増減	11,300	▲ 4,600	▲ 4,100			
当座預金残高	3,874,400	3,869,800	3,865,700			
準備預金残高	3,383,100					
積み終了先	3,383,000			10月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,383,000			積数	1,600	
非準備預金先	491,300			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	99.95%	日数	63.33%		

●2018年10月4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▲0.075~▲0.03%での調達で始まった。昨日よりも調達ニーズがやや強く、一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、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(10/4-10/5)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。T/N(10/5-10/9)は、▲0.130~▲0.105%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。アウトライ市場は、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<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、鉄鋼、ノンバンク業態から大型案件が見られ、800億円程度の償還に対して、発行は3,300億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね0%近辺での決着であった。CP等買入オペアが前回(9/25)から3,000億円減額の2,000億円でおファーされた。結果は、按分落札レート▲0.004% 平均落札レート0.000%と、オファー額減額を受けて前回(按分▲0.015% 平均▲0.009%)比で大幅な上昇となった。

●短期金融市場関連指標

2018/10/4	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	▲ 0.083	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.097	0.155	0.020	23,975.62	▲ 135.34	114.50-52	114.29-31
T/N			0.000				-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.034	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.106						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.117						
1M	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.124						
3M							▲ 0.276	▲ 0.143						
6M							▲ 0.151	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.155						
									日付	9/27	9/28	10/1	10/2	10/3
									日銀当預残	3,947,900	3,955,800	3,931,500	3,922,700	3,863,100
									準備預金残	3,462,800	3,469,000	3,442,900	3,430,400	3,380,600
									マネタリーベース	5,042,400	5,050,900	5,025,600	5,016,700	4,956,800
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.060%
									コール市場残高	123,029	64,453	111,389	114,834	114,079
									うち無担	94,437	54,181	83,422	88,736	86,520
									うちO/N	56,762	31,241	52,602	56,771	54,025
									うち有担	28,592	10,272	27,967	26,098	27,559

●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)
流動性供給	271	-	5,000	2018/10/5		9,187.0	4,997.00		0.0370%	30.4832%		0.0280%	

●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
CP等買入	2,000	2018/10/10			4,993	1,990	▲0.004		0.000	1.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	96,019	2018/10/4	2018/10/5		2,116	2,116		▲0.600	▲0.601	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/10/4	2018/10/5		2	2		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月5日の予定

*8月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比▲0.1%)	*米国8月の貿易収支	*国庫短期証券(787回)入札 (3ヶ月、43,000億円、10/9発行)
*8月の毎月勤労統計調査速報	*米国8月の消費者信用残高	
*8月の景気動向指数速報	*米国9月の雇用統計	
*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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