

Central Daily Market Report

2018年10月5日(金)

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5日		2018年10月9日		2018年10月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		1,000		1,000	
財政	▲ 5,900		▲ 1,300		1,000	
資金過不足	▲ 6,200		▲ 300		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			1,400	▲ 2,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			2,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 200	2,000	
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	▲ 2,600	2,200		2,600		
当預増減	▲ 6,800		4,100		4,000	
当座預金残高	3,867,600		3,871,700		3,875,700	
準備預金残高	3,382,700					
積み終了先	3,382,600		10月9日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	3,382,600				1,000	
非準備預金先	484,900		1日平均		100	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,003,300	
準備預金進捗率	実績		99.97%		日数	
					76.67%	

●2018年10月5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▲0.07~▲0.02%での調達で始まった。週末4日積みということもあり、調達ニーズが強く、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、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.02%近辺の出合いが見られた。共通担保資金供給オペは8,000億円(10/9~10/22)オファーされ、応札額1,403億円(期落ち分2,142億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(10/5-10/9)は、▲0.100~▲0.090%程度の出合い。T/N(10/9-10/10)は、▲0.110~▲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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.25%から▲0.28%に買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.2847%、按分落札利回▲0.2679%とWI取引を反映し、引き続き低いレート水準での決着となった。セカンダリーでは、ショートカバーから▲0.45%で出合った後、▲0.34~▲0.33%での出合いが見られるなど、強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.173%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、鉄鋼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1,600億円程度と発行超となった。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

2018/10/5	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.095	0.145	▲ 0.010	23,783.72	▲ 191.90	113.90-91	113.83-84
T/N			0.000				-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.109						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.119						
1M			▲ 0.007				-	▲ 0.127						
3M							▲ 0.331	▲ 0.143						
6M							▲ 0.151	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.169	▲ 0.155						
									日付	9/28	10/1	10/2	10/3	10/4
									日銀当預残	3,955,800	3,931,500	3,922,700	3,863,100	3,874,400
									準備預金残	3,469,000	3,442,900	3,430,400	3,380,600	3,383,100
									マネタリーベース	5,050,900	5,025,600	5,016,700	4,956,800	4,969,000
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.060%	▲0.057%
									コール市場残高	64,453	111,389	114,834	114,079	112,873
									うち無担	54,181	83,422	88,736	86,520	86,820
									うちO/N	31,241	52,602	56,771	54,025	53,425
									うち有担	10,272	27,967	26,098	27,559	26,053

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	787	-	43,000	2018/10/9	2019/1/15	152,970.0	34,860.9	100.0720	▲0.2679%	95.1250%	100.0765	▲0.2847%	8,139.0

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/10/9	2018/10/22		1,403	1,403				
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/10/9			3,631	1,808	▲0.005		▲0.003	73.8
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/10/9			1,955	504	▲0.003		▲0.002	30.2
国債買入(物価連動債)	250	2018/10/9			1,454	251	▲0.060		▲0.062	96.4
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	65,688	2018/10/5	2018/10/9		2,558	2,558		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月8日の予定

*体育の日

*米国祝日(Columbus Day)

●2018年10月9日の予定

*8月の国際収支

*9月の景気ウォッチャー調査

*国庫短期証券(788回)入札

(6ヶ月、23,000億円、10/10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