Central Daily Market Report

2018年10月9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9日 需給速報		2018年10月10日 需給予想		2018年10月11日 当社予想	
銀行券	900		800		1,000	
財政	200		▲ 1,400		2,000	
資金過不足	1,100		▲ 600		3,000	
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	2,000	▲ 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	▲ 1,300	2,600		1,300		
当預増減	4,200		2,500		3,000	

当座預金残高	3,871,800	3,874,300	3,877,300
準備預金残高	3,396,100		
積み終了先	3,396,000		
超過準備	3,396,000		
非準備預金先	475,700		

10月10日以降の残り所要積立額	
積数	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 80.00%

●2018年10月9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～▲0.02%での調達で始まった。先週末より調達ニーズはやや弱めとなり、一巡後は、▲0.08～▲0.07%近辺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▲0.02%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(10/9-10/10)は、▲0.105～▲0.090%程度の出合い。T/N(10/10-10/11)は、▲0.110～▲0.095%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、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.22～▲0.21%と強めの出合いが見られる中、平均落札利回▲0.2003%、按分落札利回▲0.1823%と、前回債からレートは低下したものの、按分レートが流れる結果となった。セカンダリーでは、レートが低い水準での買いは薄く、▲0.183～▲0.178%出合いと小甘く推移した。この他に、3M物が▲0.32%、1Y物が▲0.175%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額500億円程度に対して、発行総額は100億円程度と償還超であった。案件がほとんど無く閑散とした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

2018/10/9	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.052				－	▲ 0.098
T/N			0.000				－	▲ 0.108
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.021				－	▲ 0.114
2W			▲ 0.010				－	▲ 0.119
3W			▲ 0.020				－	▲ 0.121
1M							－	▲ 0.129
3M			0.180				▲ 0.330	▲ 0.144
6M							▲ 0.178	▲ 0.146
1Y							▲ 0.175	▲ 0.156

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.155	0.010	23,469.39	▲ 314.33	113.12-13	113.30-32

日付	10/1	10/2	10/3	10/4	10/5
日銀当預残	3,931,500	3,922,700	3,863,100	3,874,400	3,867,600
準備預金残	3,442,900	3,430,400	3,380,600	3,383,100	3,382,800
マネタリーベース	5,025,600	5,016,700	4,956,800	4,969,000	4,962,500
無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.062%	▲0.060%	▲0.057%	▲0.051%
コール市場残高	111,389	114,834	114,079	112,873	112,826
うち無担	83,422	88,736	86,520	86,820	84,999
うちO/N	52,602	56,771	54,025	53,425	51,314
うち有担	27,967	26,098	27,559	26,053	27,827

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	788	－	23,000	2018/10/10	2019/4/10	72,194.0	18,713.6	100.0910	▲0.1823%	97.8947%	100.1000	▲0.2003%	4,286.0

●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）	120,325	2018/10/9	2018/10/10		1,214	1,214		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	2,971	2018/10/9	2018/10/10		10	10		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月10日の予定

*8月の機械受注統計
（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲4.0%）

*米国8月の卸売売上高
*米国9月の生産者物価指数

*交付税特別会計借入
（10,500億円、10/19借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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