

# Central Daily Market Report

2018年10月10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10日		2018年10月11日		2018年10月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		▲ 300		0	
財政	▲ 1,700		▲ 1,400		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 900		▲ 1,700		▲ 6,000	
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						
国債買入			5,100			
CP等買入	2,000	▲ 200		▲ 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						
E T F 買入			300			
国債補完供給	▲ 1,900	1,300		1,900		
当預増減	300		5,400		▲ 6,000	
当座預金残高	3,872,100		3,877,500		3,871,500	
準備預金残高	3,404,000					
積み終了先	3,403,900				10月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,403,900				積数	
非準備預金先	468,100				1日平均	
					200	
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	83.33%		

## ●2018年10月10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。昨日よりもビッドサイドが増加したものの、レート水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は、▲0.07%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(10/10-10/11)は、▲0.100~▲0.090%程度の出合い。T/N(10/11-10/12)は、▲0.120~▲0.105%程度での出合い。TNはオファーが薄くレート低下となった。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、短国買入オペが見送られ、一般的に閑散小動きのマーケットとなったものの、明日のオペ実施を期待する向きもあり、引け際には3M物で▲0.32%、6M物で▲0.183~▲0.182%の出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,200億円程度に対して、発行総額は1,600億円程度と発行超であった。一部の不動産業態において大型案件が見られたものの、案件数少なく落ち着い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

2018/10/10	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.096	0.150	▲ 0.005	23,506.04	36.65	113.01-03	113.07-08
T/N			0.000				-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.115						
2W	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.007				-	▲ 0.120						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.123						
1M							-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.320	▲ 0.146						
6M							▲ 0.182	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.172	▲ 0.156						
									日付	10/2	10/3	10/4	10/5	10/9
									日銀当預残	3,922,700	3,863,100	3,874,400	3,867,600	3,871,800
									準備預金残	3,430,400	3,380,600	3,383,100	3,382,800	3,395,900
									マネタリーベース	5,016,700	4,956,800	4,969,000	4,962,500	4,965,900
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.060%	▲0.057%	▲0.051%	▲0.052%
									コール市場残高	114,834	114,079	112,873	112,826	105,596
									うち無担	88,736	86,520	86,820	84,999	79,326
									うちO/N	56,771	54,025	53,425	51,314	47,721
									うち有担	26,098	27,559	26,053	27,827	26,270

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2018/10/19	2019/4/19	238,168.0	10,500.12		0.0000%	4.4310%		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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/10/11			1,893	500	0.003		0.004	77.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/10/11			10,269	4,510	▲0.005		▲0.004	26.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	238,141	2018/10/10	2018/10/11		1,831	1,831		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/10/12	2018/10/18	2.69	0	0				

## ●2018年10月11日の予定

*櫻井審議委員、秋田県金融経済懇談会にて講演	*米9月の財政収支	*30年利付国債入札(7,000億円、10/12発行)
*8月の特定サービス産業動態統計速報	*米9月の消費者物価指数	
*9月の企業物価指数		

◆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