

Central Daily Market Report

2018年10月11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11日		2018年10月12日		2018年10月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		0		0	
財政	▲ 1,100		▲ 2,900		82,000	
資金過不足	▲ 1,300		▲ 2,900		82,000	
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						▲ 1,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入			1,000			
国債買入	5,100					
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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	300					
国債補完供給	▲ 1,100	1,900		1,100		
当預増減		4,700		▲ 1,100		80,100
当座預金残高		3,876,800		3,875,700		3,955,800
準備預金残高		3,399,800				
積み終了先		3,399,600				
超過準備		3,399,600				
非準備預金先		477,000				
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	99.98%	日数	86.67%	

●2018年10月11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~▲0.015%での調達で始まった。積みの着地に向けて、取り調整に入る先が増加したことで、昨日よりもレート水準が若干ながら上昇した。一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出会いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(10/11-10/12)は、▲0.110~▲0.095%程度の出合い。T/N(10/12-10/15)は、▲0.135~▲0.11%程度での出合い。T/Nは資金調達ニーズが薄くレートは低下傾向となった。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、レートが低水準で推移していることから、短国買入オペの有無が注目されていたが、1,000億円(前回と同額)でオファーされた。買入額が少額にとどまる中、全取利回較差+0.016%、平均落札利回較差+0.016%と在庫調整の売りからか、弱い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.320~▲0.311%、6M物が▲0.185~▲0.183%、1Y物が▲0.170~▲0.165%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。CP発行市場は償還総額4,100億円程度に対して、発行総額は3,700億円程度と償還超であった。5・10日発行となり複数業態において大型案件が見られたものの、案件数は膨らまず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。本日はCP等買入オペが2,000億円オファーされた。結果は平均落札レート▲0.001%・按分レート▲0.004%と、前回(平均0.000%・按分▲0.004%)比で平均落札レートが僅かに低下した。

●短期金融市場関連指標

2018/10/11	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.100	0.140	▲ 0.010	22,590.86	▲ 915.18	112.08-09	112.22-23
T/N			0.000				-	▲ 0.118						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.019				-	▲ 0.120						
2W							-	▲ 0.123						
3W			0.000				-	▲ 0.128						
1M	▲ 0.015	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.132						
3M			0.003				▲ 0.319	▲ 0.149						
6M							▲ 0.185	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.157						
									日付	10/3	10/4	10/5	10/9	10/10
									日銀当預残	3,863,100	3,874,400	3,867,600	3,871,800	3,872,100
									準備預金残	3,380,600	3,383,100	3,382,800	3,395,900	3,404,000
									マネタリーベース	4,956,800	4,969,000	4,962,500	4,965,900	4,965,300
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.057%	▲0.051%	▲0.052%	▲0.053%
									コール市場残高	114,079	112,873	112,826	105,596	109,144
									うち無担	86,520	86,820	84,999	79,326	84,413
									うちO/N	54,025	53,425	51,314	47,721	53,408
									うち有担	27,559	26,053	27,827	26,270	24,731

●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)
30年利付国債	60	0.90%	7,000	2018/10/12	2048/9/20	22,238.0	5,674.00	100.0000	0.9000%	69.4027%	100.0400	0.8980%	1,317.0

●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	応募総額(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
国庫短期証券買入	1,000	2018/10/12			9,540	1,000		0.016	0.016	
CP等買入	2,000	2018/10/16			4,731	1,975	▲0.004		▲0.001	88.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	148,391	2018/10/11	2018/10/12		1,118	1,118		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月12日の予定

*8月の第3次産業活動指数	*10月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(789回)入札(3ヶ月、42,800億円、10/15発行)
*9月のマネーストック		*エネルギー対策借入(6,500億円、10/22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