

Central Daily Market Report

2018年10月12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12日		2018年10月15日		2018年10月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		500		0	
財政	▲ 3,000		80,600		1,000	
資金過不足	▲ 2,900		81,100		1,000	
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			1,800	▲ 1,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			9,300			
CP等買入		▲ 300		▲ 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			800			
国債補完供給	▲ 1,300	1,100		1,300		
当預増減	▲ 2,400		92,200		3,000	
当座預金残高	3,874,400		3,966,600		3,969,600	
準備預金残高	3,394,800					
積み終了先	3,394,700					
超過準備	3,394,600					
非準備預金先	479,600					
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	99.99%	日数	96.67%		

●2018年10月12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▲0.06~▲0.01%での調達で始まった。引き続き取り調整の動きが見られ、週末要因も重なったことでレート水準が上昇した。一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06%近辺の出合いが散見される中、今週の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オペは8,000億円(10/15~10/29)オファーされ、応札額1,841億円(期落ち分1,891億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(10/12-10/15)は、▲0.120~▲0.100%程度の出合い。T/N(10/15-10/16)は、▲0.145~▲0.130%程度での出合い。積み最終日となるT/Nは資金調達ニーズが薄く、レートは低下した。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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.25%から▲0.32%に買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.2943%、按分落札利回▲0.2716%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、▲0.3025%で少額出合った程度であった。この他に、6M物が▲0.188~▲0.185%、1Y物が▲0.175~▲0.17%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発行市場は石油業態から比較的多まった案件が見られたものの、償還総額350億円程度に対して、発行総額は650億円にとどまった。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

2018/10/12	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	0.005	▲ 0.042				-	▲ 0.106	0.145	0.005	22,694.66	103.80	112.08-09	112.32-33
T/N	▲ 0.055	0.000	▲ 0.041				-	▲ 0.131						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.013				-	▲ 0.131						
2W	▲ 0.020	▲ 0.012	▲ 0.016				-	▲ 0.130						
3W			0.035				-	▲ 0.133						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.135						
3M			0.001				▲ 0.295	▲ 0.149						
6M							▲ 0.188	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.174	▲ 0.156						
									日付	10/4	10/5	10/9	10/10	10/11
									日銀当預残	3,874,400	3,867,600	3,871,800	3,872,100	3,876,800
									準備預金残	3,383,100	3,382,800	3,395,900	3,404,000	3,399,800
									マネタリーベース	4,969,000	4,962,500	4,965,900	4,965,300	4,970,100
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.051%	▲0.052%	▲0.053%	▲0.050%
									コール市場残高	112,873	112,826	105,596	109,144	109,158
									うち無担	86,820	84,999	79,326	84,413	88,068
									うちO/N	53,425	51,314	47,721	53,408	57,413
									うち有担	26,053	27,827	26,270	24,731	21,090

●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)
国庫短期証券	789	-	42,800	2018/10/15	2019/1/21	134,197.0	34,714.8	100.0730	▲0.2716%	40.2500%	100.0791	▲0.2943%	8,085.0
エネルギー対策	-	-	6,500	2018/10/22	2019/10/21	110,813.0	6,499.94		0.0000%	5.8658%		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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2018/10/15	2018/10/29		1,841	1,841				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2018/10/15			8,735	3,012	0.002		0.003	36.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/10/15			7,675	3,514	0.000		0.002	5.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/10/15			4,891	1,814	▲0.003		▲0.002	86.5
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/10/15			1,588	502	▲0.003		▲0.003	95.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	52,941	2018/10/12	2018/10/15		1,220	1,220		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月15日の予定

*8月の石油等消費動態統計	*米国8月の企業在庫
	*米国9月の小売売上高

◆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