

Central Daily Market Report

2018年10月15日(月)

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15日		2018年10月16日		2018年10月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		100		0	
財政	82,300		▲1,200		▲18,000	
資金過不足	82,700		▲1,100		▲18,000	
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						
国債買入	9,300					
CP等買入		▲200	2,000	▲100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入				▲100		
E T F 買入	800					
国債補完供給	▲1,900	1,300		1,900		
当預増減	91,900		2,600		▲18,000	
当座預金残高	3,966,300		3,968,900		3,950,900	
準備預金残高	3,484,500					
積み終了先	3,484,500					
超過準備	3,484,300					
非準備預金先	481,800					
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,103,600	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2018年10月15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▲0.055~▲0.010%での調達で始まった。積み最終日にあたることから積極的な調達が見られ、レート水準が上昇した。一巡後には最終調整のビッドから▲0.050~▲0.015%程度の出合いが見られる中、今積み期の取引を終えた。ターム物に関しては来積み期スタートのショートターム物で▲0.030~▲0.020%程度での出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(10/15-10/16)は▲0.115~▲0.085%程度、T/N(10/16-10/17)は▲0.16~▲0.105%程度で出合いが見られた。10/15受渡の取引は積みの調整目的の資金調達希望が見られた一方、積期間の変わる10/16受渡の取引は調達サイドが慎重で、レートが低下した。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。個別銘柄では10Y340~352や、5Y126、129、130、131、135などにビッドが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは小幅低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物で▲0.295~▲0.28%、1Y物で▲0.18%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、小売業態、ノンバンク業態で比較的まとまった額の発行がみられ、償還総額400億円程度に対し、発行総額は1,500億円程度と発行超のマーケットとなった。発行レートは0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/10/15	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲0.075	0.001	▲0.040				-	▲0.099	0.140	▲0.005	22,271.30	▲423.36	112.20-22	111.79-80
T/N			0.000				-	▲0.133						
S/N							-	-						
1W	▲0.030	0.000	▲0.023				-	▲0.138						
2W	▲0.030	▲0.020	▲0.027				-	▲0.137						
3W			0.000				-	▲0.138						
1M			▲0.027				-	▲0.139						
3M							▲0.290	▲0.149						
6M							▲0.188	▲0.149						
1Y							▲0.179	▲0.157						
									日付	10/5	10/9	10/10	10/11	10/12
									日銀当預残	3,867,600	3,871,800	3,872,100	3,876,800	3,874,400
									準備預金残	3,382,800	3,395,900	3,404,000	3,399,800	3,394,800
									マネタリーベース	4,962,500	4,965,900	4,965,300	4,970,100	4,967,600
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.052%	▲0.053%	▲0.050%	▲0.042%
									コール市場残高	112,826	105,596	109,144	109,158	110,871
									うち無担	84,999	79,326	84,413	88,068	89,025
									うちO/N	51,314	47,721	53,408	57,413	58,260
									うち有担	27,827	26,270	24,731	21,090	21,846

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)	91,211	2018/10/15	2018/10/16		1,798	1,798		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,055	2018/10/15	2018/10/16		0	0				
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
被災地金融支援オペ	第90回	2018/10/19	2019/10/18	0	102					
被災地金融支援オペ(熊本)	第29回	2018/10/19	2019/10/18	0	8					

●2018年10月16日の予定

*米国9月の鉱工業生産・設備稼働率	*5年利付国債入札(20,000億円、10/17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