

Central Daily Market Report

2018年10月16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16日		2018年10月17日		2018年10月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 100		▲ 20,300		2,000	
資金過不足	0		▲ 20,400		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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入	2,000	▲ 100		▲ 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			100			
国債補完供給	▲ 1,900	1,900		1,900		
当預増減	1,800		▲ 17,500		1,000	
当座預金残高	3,968,100		3,950,600		3,951,600	
準備預金残高	3,470,900					
積み終了先	2,165,700					
超過準備	953,300					
非準備預金先	497,200					
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	81.12%	日数	3.23%		

●2018年10月16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~▲0.030%での調達で始まった。新積み期を迎え調達ニーズが落ち着き、前日比でレートは低下した。一巡後には▲0.075%程度の出合いが見ら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▲0.030~▲0.025%程度での出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(10/16-10/17)は▲0.12~▲0.11%程度、T/N(10/17-10/18)は▲0.14~▲0.105%程度で出合いが見られた。前日に続いて調達サイドが薄く、レートは低位で推移した。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は横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペが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り、按分落札利回較差+0.015%、平均落札利回較差+0.016%と在庫調整の売りから弱い結果となった。マーケットでは、6M物が▲0.189~▲0.187%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、卸売、機械等の業態でまとまった額の調達がみられ、償還総額360億円程度に対し、発行総額は2,000億円程度と発行超となった。発行レートは一部銘柄を除き、引続き0%近辺で推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/10/16	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.059				-	▲ 0.104	0.145	0.005	22,549.24	277.94	111.84-85	112.09-11
T/N			0.000				-	▲ 0.138						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.025				-	▲ 0.140						
2W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.025				-	▲ 0.139						
3W							-	▲ 0.141						
1M			0.001				-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.290	▲ 0.150						
6M							▲ 0.188	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.179	▲ 0.157						
									日付	10/9	10/10	10/11	10/12	10/15
									日銀当預残	3,871,800	3,872,100	3,876,800	3,874,400	3,966,300
									準備預金残	3,395,900	3,404,000	3,399,800	3,394,800	3,482,100
									マネタリーベース	4,965,900	4,965,300	4,970,100	4,967,600	5,059,200
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.053%	▲0.050%	▲0.042%	▲0.039%
									コール市場残高	105,596	109,144	109,158	110,871	117,667
									うち無担	79,326	84,413	88,068	89,025	94,871
									うちO/N	47,721	53,408	57,413	58,260	64,736
									うち有担	26,270	24,731	21,090	21,846	22,796

●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)
5年利付国債	137	0.10%	20,000	2018/10/17	2023/9/20	79,965.0	16,373.00	100.7600	▲0.0530%	40.2505%	100.7700	▲0.0550%	3,616.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2018/10/17			7,566	1,001	0.015		0.016	75.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2018/10/16	2018/10/17		1,798	1,798		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2018/10/18	2018/10/25	2.69	0	0				

●2018年10月17日の予定

- *米9月の住宅着工件数
- *英国9月の消費者物価指数
- *ユーロ圏9月の消費者物価指数改定値
- *交付税特別会計借入(10,500億円、10/25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