

Central Daily Market Report

2018年10月18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18日		2018年10月19日		2018年10月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 600		0	
財政	▲ 700		▲ 3,700		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 1,800		▲ 4,300		▲ 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						▲ 1,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,400					
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			100	▲ 100		
社債等買入				▲ 300		
ETF買入	100		100			
国債補完供給	▲ 1,700	1,300		1,700		
当預増減	10,200		▲ 3,000		▲ 7,400	
当座預金残高	3,959,200		3,956,200		3,948,800	
準備預金残高	3,461,100					
積み終了先	3,420,500				10月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,403,000				積数 62,200	
非準備預金先	498,100				1日平均 2,200	
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		98.00%		日数 9.68%	

●2018年10月18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▲0.085~▲0.035%での調達で始まった。一巡後には▲0.080~▲0.035%程度の出合いが散見される中、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▲0.035%程度での出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(10/18-10/19)は▲0.105~▲0.10%程度、T/N(10/19-10/22)は▲0.155~▲0.12%程度で出合いが見られた。前場から運用サイドがしっかりとおり、レート低位での出合いとなった。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。個別銘柄では10Y340~350や、5Y126、130、131などにビッドが目立った。入札のあった20年債は比較的落ち着いた取引だった。

<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、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.175~▲0.16%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1681%、按分落札利回▲0.1551%と前回債からレートは低下したものの、按分レートがやや流れる結果となった。セカンダリーでは、▲0.168%で少額出合った程度。この他に、3M物が▲0.294%、6M物が▲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、発行銘柄にやや広がりが見られ、償還総額750億円程度に対し、発行総額は1,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏で推移したが、発行頻度の低い銘柄で低めのレートでの出合いが見られた。

●短期金融市場関連指標

2018/10/18	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.107	0.149	0.006	22,658.16	▲ 182.96	112.61-63	112.61-62
T/N	▲ 0.040	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.146						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.145						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.145						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.145						
1M	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.030				-	▲ 0.145						
3M			0.200				▲ 0.289	▲ 0.150						
6M							▲ 0.187	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.157						
									日付	10/11	10/12	10/15	10/16	10/17
									日銀当預残	3,876,800	3,874,400	3,966,300	3,968,100	3,949,000
									準備預金残	3,399,800	3,394,800	3,482,100	3,470,900	3,454,800
									マナタリベース	4,970,100	4,967,600	5,059,200	5,060,900	5,042,000
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.042%	▲0.039%	▲0.058%	▲0.061%
									コール市場残高	109,158	110,871	117,667	107,935	110,311
									うち無担	88,068	89,025	94,871	91,572	91,668
									うちO/N	57,413	58,260	64,736	60,237	59,083
									うち有担	21,090	21,846	22,796	16,363	18,643

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	790	-	21,000	2018/10/22	2019/10/21	79,903.0	17,320.7	100.1550	▲0.1551%	51.7525%	100.1680	▲0.1681%	3,679.0
20年利付国債	166	0.70%	10,000	2018/10/19	2038/9/20	33,853.0	8,003.0	100.2500	0.6850%	41.8922%	100.2900	0.6830%	1,986.0

●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	申込総額(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
社債等買入	1,000	2018/10/24			2,103	1,000	▲0.039		▲0.018	48.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	13,635	2018/10/18	2018/10/19		1,656	1,656		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月19日の予定

*黒田日銀総裁、全国信用組合大会にて講演	*米国9月の中古住宅販売	*国庫短期証券(791回)入札(3ヶ月、43,200億円、10/22発行)
*9月の全国消費者物価指数(CPI)		
市場予想：前年同月比(除く生鮮)+1.0%		

◆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