

# Central Daily Market Report

2018年10月19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19日		2018年10月22日		2018年10月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		300		▲ 1,000	
財政	▲ 4,800		▲ 7,900		1,000	
資金過不足	▲ 5,300		▲ 7,600		0	
<b>金融調節</b>	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			1,500	▲ 1,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			2,900			
CP等買入		▲ 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				
E T F 買入	100		500			
国債補完供給	▲ 1,900	1,700		1,900		
当預増減	▲ 5,900		▲ 2,200		0	
当座預金残高	3,953,300		3,951,100		3,951,100	
準備預金残高	3,443,800					
積み終了先	3,440,700				10月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,429,400				積数	18,800
非準備預金先	509,500				1日平均	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	99.39%	日数	19.35%		

## ●2018年10月19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▲0.080~▲0.035%での調達で始まった。一巡後には▲0.075~▲0.045%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特段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(10/22~11/5)オファーされ、応札額1,502億円(期落ち分1,403億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T+0(10/19-10/22)は出合いなし、T/N(10/22-10/23)は▲0.135~▲0.11%程度の出合いだった。22日は短国1年物、3ヶ月物の発行日にあたり、調達サイドが積極的だった。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。

### <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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.28%から▲0.31%に買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.2966%、按分落札利回▲0.2772%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、▲0.29%~▲0.282%出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、6M物が▲0.192%~▲0.187%、1Y物が▲0.165%で少額出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、案件数は膨らまなかったものの、卸売業態1社で900億円程度の大型案件が実施され、発行総額は1,100億円程度と償還総額の650億円程度を上回った。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/10/19	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.117	0.145	▲ 0.004	22,532.08	▲ 126.08	112.19-21	112.43-44
T/N			0.000				-	▲ 0.134						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.230	▲ 0.015				-	▲ 0.140						
2W			0.000				-	▲ 0.143						
3W							-	▲ 0.143						
1M							-	▲ 0.144						
3M							▲ 0.282	▲ 0.150						
6M							▲ 0.190	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.157						
									日付	10/12	10/15	10/16	10/17	10/18
									日銀当預残	3,874,400	3,966,300	3,968,100	3,949,000	3,959,200
									準備預金残	3,394,800	3,482,100	3,470,900	3,454,800	3,461,100
									マネタリーベース	4,967,600	5,059,200	5,060,900	5,042,000	5,053,400
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.039%	▲0.058%	▲0.061%	▲0.064%
									コール市場残高	110,871	117,667	107,935	110,311	107,681
									うち無担	89,025	94,871	91,572	91,668	91,287
									うちO/N	58,260	64,736	60,237	59,083	58,072
									うち有担	21,846	22,796	16,363	18,643	16,394

## ●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	791	-	43,200	2018/10/22	2019/1/28	132,407.0	35,026.9	100.0745	▲0.2772%	71.0099%	100.0797	▲0.2966%	8,173.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/10/22	2018/11/5		1,502	1,502				
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/10/22			6,339	1,813	▲0.003		▲0.003	99.7
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/10/22			1,783	506	▲0.003		▲0.003	56.8
国債買入(物価連動債)	250	2018/10/22			1,237	250	▲0.050		▲0.089	20.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2018/10/19	2018/10/22		1,862	1,862		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年10月22日の予定

\*特にありません。

◆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