

Central Daily Market Report

2018年10月22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22日		2018年10月23日		2018年10月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 700		▲ 1,000	
財政	▲ 5,000		▲ 1,000		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 4,800		▲ 1,700		▲ 5,000	
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	1,500	▲ 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				▲ 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						1,000
E T F 買入	500		400			
国債補完供給	▲ 2,600	1,900		2,600		
当預増減	▲ 2,000		1,200		▲ 4,000	
当座預金残高	3,951,300		3,952,500		3,948,500	
準備預金残高	3,452,100					
積み終了先	3,448,500		10月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,448,500		積数		15,200	
非準備預金先	499,200		1日平均		600	
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		99.51%		日数	
					22.58%	

●2018年10月22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▲0.075%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。

<レポ市場>

GC T+0(10/22-10/23)は▲0.12~▲0.11%程度の気配、T/N(10/23-10/24)は▲0.135~▲0.11%程度の出合い。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10Y339~350や、5Y135、136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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.29~▲0.286%、6M物が▲0.195%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、発行総額300億円程度に対して、償還総額400億円程度と償還超となった。案件は少なく閑散としたマーケットとなった。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

2018/10/22	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	▲ 0.069				-	▲ 0.111	0.150	0.005	22,614.82	82.74	112.45-46	112.75-76
T/N			0.000				-	▲ 0.134						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.140						
2W	▲ 0.025	▲ 0.023	▲ 0.025				-	▲ 0.145						
3W							-	▲ 0.145						
1M	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.145						
3M							▲ 0.286	▲ 0.150						
6M							▲ 0.190	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.158						
									日付	10/15	10/16	10/17	10/18	10/19
									日銀当預残	3,966,300	3,968,100	3,949,000	3,959,200	3,953,300
									準備預金残	3,482,100	3,470,900	3,454,800	3,461,100	3,443,800
									マネタリーベース	5,059,200	5,060,900	5,042,000	5,053,400	5,048,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.058%	▲ 0.061%	▲ 0.064%	▲ 0.068%
									コール市場残高	117,667	107,935	110,311	107,681	107,982
									うち無担	94,871	91,572	91,668	91,287	93,552
									うちO/N	64,736	60,237	59,083	58,072	60,137
									うち有担	22,796	16,363	18,643	16,394	14,430

●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)	83,997	2018/10/22	2018/10/23		2,390	2,390		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	6,506	2018/10/22	2018/10/23		79	79		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月23日の予定

*月例経済報告	*流動性供給入札 (6,000億円、10/24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