

Central Daily Market Report

2018年10月24日(水)

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24日		2018年10月25日		2018年10月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 1,600		▲ 2,000	
財政	▲ 7,300		2,200		1,000	
資金過不足	▲ 8,000		600		▲ 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			7,900			
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						
社債等買入	1,000					
E T F 買入	300		900			
国債補完供給	▲ 800	2,500		800		
当預増減	▲ 4,100		10,000		▲ 1,000	
当座預金残高	3,945,000		3,955,000		3,954,000	
準備預金残高	3,434,400					
積み終了先	3,433,200		10月25日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,432,600		積数		10,700	
非準備預金先	510,600		1日平均		500	
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		99.66%		日数	
					29.03%	

●2018年10月24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~▲0.075%程度の出合いが散見される中、本日の取引を終えた。また、本日は大手証券業態の試し取りが実施され、0.001%でまとまった出合いが見られていた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.085%程度で出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(10/24-10/25)は▲0.13~▲0.12%程度の出合い、T/N(10/25-10/26)は▲0.14~▲0.13%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10Y339~352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▲0.295~▲0.29%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は案件少なく、償還総額700億円程度に対して、発行総額は300億円程度にとどまった。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

2018/10/24	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.030	▲ 0.057					-	▲ 0.121	0.130	▲ 0.015	22,091.18	80.40	112.44-46	112.50-51
T/N			0.000					-	▲ 0.139						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.035					-	▲ 0.144						
2W	▲ 0.027	▲ 0.010	▲ 0.015					-	▲ 0.144						
3W								-	▲ 0.145						
1M								-	▲ 0.145						
3M								▲ 0.295	▲ 0.151						
6M								▲ 0.190	▲ 0.151						
1Y								▲ 0.167	▲ 0.158						
										日付	10/17	10/18	10/19	10/22	10/23
										日銀当預残	3,949,000	3,959,200	3,953,300	3,951,300	3,949,100
										準備預金残	3,454,800	3,461,100	3,443,800	3,452,100	3,451,600
										マネタリーベース	5,042,000	5,053,400	5,048,000	5,045,800	5,044,300
										無担O/N加重平均	▲ 0.061%	▲ 0.064%	▲ 0.068%	▲ 0.069%	▲ 0.069%
										コール市場残高	110,311	107,681	107,982	102,577	108,020
										うち無担	91,668	91,287	93,552	86,436	90,039
										うちO/N	59,083	58,072	60,137	52,211	56,654
										うち有担	18,643	16,394	14,430	16,141	17,981

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2018/11/2	2019/5/2	225,256.0	10,500.12		0.0000%	4.6615%		0.0000%	

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/10/25			2,156	502	0.005		0.006	82.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/10/25			7,649	4,501	▲ 0.013		▲ 0.009	11.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/10/25			5,868	1,809	▲ 0.016		▲ 0.014	8.9
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/10/25			1,599	504	▲ 0.015		▲ 0.014	30.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,295	2018/10/24	2018/10/25		726	726		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年10月25日の予定

*若田部日銀副総裁、「ニッポンの革新力」シンポジウムにて講演	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*2年利付国債入札(21,000億円、11/1発行)
*9月の企業向けサービス価格指数	*米国9月の耐久財新規受注	

◆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