

Central Daily Market Report

2018年10月25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25日 需給速報	2018年10月26日 需給予想	2018年10月29日 当社予想
銀行券	▲ 1,600	▲ 700	0
財政	1,800	200	▲ 2,000
資金過不足	200	▲ 500	▲ 2,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 1,800
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	7,900		
CP等買入		▲ 200	▲ 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			
E T F買入	900		1,100
国債補完供給	▲ 700	800	700
当預増減	8,900	1,100	▲ 3,800
当座預金残高	3,953,900	3,955,000	3,951,200
準備預金残高	3,455,800		
積み終了先	3,455,400		10月26日以降の残り所要積立額
超過準備	3,455,100		積数 10,000
非準備預金先	498,100		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	99.68%	日数 32.26%

●2018年10月25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~▲0.040%での調達で始まった。一巡後には▲0.080~▲0.060%程度の出合いが散見される中、本日の取引を終えた。ま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(10/25-10/26)は▲0.14~▲0.13%程度の出合い。T/N(10/26-10/29)は▲0.16~▲0.15%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は小幅低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、償還総額200億円程度に対して、発行総額は750億円程度と発行超の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

2018/10/25	無担(速報)			有担(速報)			短期 先買参考統計値	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				-	▲ 0.152	0.110	▲ 0.020	21,268.73	▲ 822.45	111.99-01	112.30-32
T/N			0.000				-	▲ 0.157						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.037				-	▲ 0.156						
2W	▲ 0.010	0.350	0.080				-	▲ 0.151						
3W			0.001				-	▲ 0.148						
1M							-	▲ 0.149						
3M							▲ 0.300	▲ 0.151						
6M							▲ 0.195	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.167	▲ 0.159						
									日付	10/18	10/19	10/22	10/23	10/24
									日銀当預残	3,959,200	3,953,300	3,951,300	3,949,100	3,945,000
									準備預金残	3,461,100	3,443,800	3,452,100	3,451,600	3,434,400
									マネタリーベース	5,053,400	5,048,000	5,045,800	5,044,300	5,040,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.068%	▲ 0.069%	▲ 0.069%	▲ 0.057%
									コール市場残高	107,681	107,982	102,577	108,020	117,414
									うち無担	91,287	93,552	86,436	90,039	103,314
									うちO/N	58,072	60,137	52,211	56,654	66,479
									うち有担	16,394	14,430	16,141	17,981	14,100

●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)
2年利付国債	394	0.10%	21,000	2018/11/1	2020/11/1	92,158.0	17,360.00	100.4350	▲0.1160%	71.4439%	100.4360	▲0.1170%	3,630.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	52,937	2018/10/25	2018/10/26		513	513		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/10/25	2018/10/26		150	150		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月26日の予定

*10月の都区部消費者物価指数(CPI)
市場予想:前年同月比(除く生鮮)+1.0%

*米国7-9月期のGDP速報値

*国庫短期証券(792回)入札
(3ヶ月、43,000億円、10/29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