

# Central Daily Market Report

2018年10月26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26日		2018年10月29日		2018年10月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		200		▲ 1,000	
財政	1,300		▲ 2,800		2,000	
資金過不足	500		▲ 2,600		1,000	
<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			2,100	▲ 1,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,100			
CP等買入		▲ 200		▲ 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				▲ 100		
E T F買入	1,100		600			
国債補完供給	▲ 1,300	700		1,300		
当預増減	800		10,500		1,000	
当座預金残高	3,954,700		3,965,200		3,966,200	
準備預金残高	3,453,700					
積み終了先	3,452,900				10月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,452,900				積数	7,700
非準備預金先	501,000				1日平均	400
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	99.75%	日数	41.94%		

## ●2018年10月26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▲0.085~▲0.045%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。共通担保資金供給オペは8,000億円(10/29~11/12)オファーされ、応札額2,142億円(期落ち分1,841億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T+0(10/26-10/29)は▲0.15~▲0.14%程度の出合い。T/N(10/29-10/30)は▲0.16~▲0.12%程度の出合い。TNはTDB3M物発行の影響で、業者の売物が増加している。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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.33%から▲0.37%まで買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.3211%、按分落札利回▲0.2958%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、引け際に▲0.323~▲0.296%で散発的に出合いが見られた。この他に、1Y物が▲0.169%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、卸売・機械・石油業態等から大型案件が実施され、償還総額1,900億円程度に対して、発行総額は3,500億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。本日はCP等買入オペが2,000億円でおファーされた。結果は平均落札レート0.002%・按分レート▲0.002%と前回(平均▲0.001%・按分▲0.004%)比で両レートとも上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/10/26	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	▲ 0.071				-	▲ 0.140	0.110	0.000	21,184.60	▲ 84.13	112.36-37	112.01-02
T/N			0.000				-	▲ 0.155						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.012	▲ 0.033				-	▲ 0.157						
2W							-	▲ 0.151						
3W							-	▲ 0.149						
1M							-	▲ 0.149						
3M							▲ 0.320	▲ 0.151						
6M							▲ 0.195	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.167	▲ 0.159						
									日付	10/19	10/22	10/23	10/24	10/25
									日銀当預残	3,953,300	3,951,300	3,949,100	3,945,000	3,953,900
									準備預金残	3,443,800	3,452,100	3,451,600	3,434,400	3,455,800
									マネタリーベース	5,048,000	5,045,800	5,044,300	5,040,900	5,051,400
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.069%	▲0.069%	▲0.057%	▲0.069%
									コール市場残高	107,982	102,577	108,020	117,414	101,683
									うち無担	93,552	86,436	90,039	103,314	87,272
									うちO/N	60,137	52,211	56,654	66,479	54,057
									うち有担	14,430	16,141	17,981	14,100	14,411

## ●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	792	-	43,000	2018/10/29	2019/2/4	125,746.5	34,910.4	100.0795	▲0.2958%	74.7479%	100.0863	▲0.3211%	8,089.0

## ●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	2018/10/29	2018/11/12		2,142	2,142				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2018/10/29			7,757	3,006	0.000		0.002	23.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/10/29			6,237	3,503	0.000		0.002	3.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/10/29			11,686	4,502	0.006		0.007	50.0
CP等買入	2,000	2018/10/31			5,606	1,960	▲0.002		0.002	93.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	36,282	2018/10/26	2018/10/29		1,208	1,208		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年10月29日の予定

\*9月の商業動態統計速報

\*米9月の個人所得・消費支出

◆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