

Central Daily Market Report

2018年10月29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29日		2018年10月30日		2018年10月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		▲ 400		▲ 200	
財政	▲ 1,500		▲ 2,900		▲ 1,200	
資金過不足	▲ 1,400		▲ 3,300		▲ 1,400	
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	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		▲ 100		▲ 300	2,000	
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	600		200			
国債補完供給	▲ 300	1,300		300		
当預増減	11,400		▲ 3,100		600	
当座預金残高	3,966,100		3,963,000		3,963,600	
準備預金残高	3,460,900					
積み終了先	3,460,200				10月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,460,200				積数 6,900	
非準備預金先	505,200				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		99.78%		日数 45.16%	

●2018年10月29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～▲0.060%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ショートターム物で▲0.030%程度の出合いが見られていた。

＜レポ市場＞

GC T+0(10/29-10/30)は▲0.140～▲0.110%程度の出合い。T/N(10/30-10/31)は▲0.150～▲0.130%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10Y335～352、5Y135～137などにビッドの出入りが目立った。

＜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、引け際に3M物が▲0.321～▲0.315%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、2営業日後が月末日あたり、鉄鋼・機会・電力等からの大型発行も見られたほか、幅広い業態が発行を行う活況なマーケットとなったが、償還総額1兆1,500億円弱に対して、発行総額は8,900億円強にとどまった。発行レートについては、一部では積極的な買い姿勢も見られたが、概ね横ばい圏で推移する展開となった。

●短期金融市場関連指標

2018/10/29	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	▲ 0.070				-	▲ 0.129	0.105	▲ 0.005	21,149.80	▲ 34.80	111.92-94	111.92-94
T/N			0.000				-	▲ 0.148						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.028	▲ 0.033				-	▲ 0.152						
2W	▲ 0.028	▲ 0.005	▲ 0.013				-	▲ 0.151						
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.149						
1M							-	▲ 0.149						
3M							▲ 0.320	▲ 0.150						
6M							▲ 0.195	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.167	▲ 0.159						
									日付	10/22	10/23	10/24	10/25	10/26
									日銀当預残	3,951,300	3,949,100	3,945,000	3,953,900	3,954,700
									準備預金残	3,452,100	3,451,600	3,434,400	3,455,800	3,453,700
									マネタリーベース	5,045,800	5,044,300	5,040,900	5,051,400	5,053,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.069%	▲ 0.069%	▲ 0.057%	▲ 0.069%	▲ 0.071%
									コール市場残高	102,577	108,020	117,414	101,683	103,807
									うち無担	86,436	90,039	103,314	87,272	89,676
									うちO/N	52,211	56,654	66,479	54,057	55,911
									うち有担	16,141	17,981	14,100	14,411	14,131

●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)	10,000	2018/10/29	2018/10/30		292	292		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月30日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、30日まで)	*米国8月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/9借入)
*9月の完全失業率(市場予想：2.4%)	*米国10月のCB消費者信頼感指数	
*9月の有効求人倍率(市場予想：1.63倍)	*ユーロ圏7-9月期のGDP速報値	

◆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