# Central Daily Market Report

2018年10月30日（火）
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30日 需給速報 | | 2018年10月31日 需給予想 | | 2018年11月1日 当社予想 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 銀行券 | ▲ 400 | | 0 | | 0 | |
| 財政 | ▲ 3,000 | | ▲ 3,200 | | ▲ 24,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 3,400 | | ▲ 3,200 | | ▲ 24,000 | |
| 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 | | | 8,900 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 300 | 2,000 | ▲ 1,700 | | |
| 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 | | |
| ＥＴＦ買入 | 200 | | 900 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 400 | 300 | | 400 | | |
| 当預増減 | ▲ 3,600 | | 8,200 | | ▲ 24,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 3,962,500 | 3,970,700 | 3,946,700 |
| 準備預金残高 | 3,456,700 | | |
| 積み終了先 | 3,456,000 | 10月31日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,456,000 | 積数 | 6,200 |
| 非準備預金先 | 505,800 | 1日平均 | 400 |
| 積み期間（10/16～11/15）の所要準備額 | | | 3,102,600 |
| 準備預金進捗率 | 実績 99.80% | 日数 | 48.39% |

## ●2018年10月30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▲0.086～▲0.040%での調達で始まった。一巡後には▲0.060～▲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ショートターム物で▲0.040%程度の出合いが見られていた。

**<レポ市場>**

GC T+0(10/30-10/31)は▲0.130～▲0.105%程度の出合い。T/N(10/31-11/1)は▲0.180～▲0.120%程度の出合い。T/Nは月末を跨ぐ取引となることから、序盤はオファーが出難くレートを切り下げた。引けに向けては業者の調整売りから▲0.120%程度まで戻した。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は月末初に該当し、レートが低下した。アウトライト市場では、短国買入オペが1,000億円（前回と同額）でオファーされた。引き続き買入額が少額にとどまる中、按分落札利回較差＋0.000%、平均落札利回較差±0.003%と小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.32%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営業日後が月初となり、償還総額は900億円程度であったが、ノンバンク、鉄鋼等から大口の発行も見られ、発行総額は4,900億円強に膨らんだ。発行レートに目立った変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

| 2018/10/30 | 無担（速報） | | | 有担（速報） | | | 短国 | 東京レポレート |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 単位：% | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | 平均 | 売買参考統計値 | 平均値 |
| O/N | ▲ 0.086 | 0.001 | ▲ 0.072 | | | | － | ▲ 0.134 |
| T/N | | | 0.000 | | | | － | ▲ 0.175 |
| S/N | | | | | | | － | － |
| 1W | ▲ 0.050 | ▲ 0.038 | ▲ 0.042 | | | | － | ▲ 0.155 |
| 2W | ▲ 0.035 | ▲ 0.010 | ▲ 0.023 | | | | － | ▲ 0.152 |
| 3W | | | | | | | － | ▲ 0.149 |
| 1M | ▲ 0.020 | 0.020 | ▲ 0.013 | | | | － | ▲ 0.149 |
| 3M | | | 0.070 | | | | ▲ 0.320 | ▲ 0.150 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.201 | ▲ 0.151 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.169 | ▲ 0.159 |

| JGB新発10年債 | | 日経平均株価 | | ドル/円 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 | 為替（9時） | 為替（17時） |
| 0.115 | 0.010 | 21,457.29 | 307.49 | 112.33-34 | 112.80-81 |

| 日付 | 10/23 | 10/24 | 10/25 | 10/26 | 10/29 |
|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 3,949,100 | 3,945,000 | 3,953,900 | 3,954,700 | 3,966,100 |
| 準備預金残 | 3,451,600 | 3,434,400 | 3,455,800 | 3,453,700 | 3,461,100 |
| マネタリーベース | 5,044,300 | 5,040,900 | 5,051,400 | 5,053,000 | 5,064,300 |
| 無担O/N加重平均 | ▲0.069% | ▲0.057% | ▲0.069% | ▲0.071% | ▲0.070% |
| コール市場残高 | 108,020 | 117,414 | 101,683 | 103,807 | 98,295 |
| うち無担 | 90,039 | 103,314 | 87,272 | 89,676 | 84,109 |
| うちO/N | 56,654 | 66,479 | 54,057 | 55,911 | 50,344 |
| うち有担 | 17,981 | 14,100 | 14,411 | 14,131 | 14,186 |

## ●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Ｉ非価格競争入札(億円) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 交付税特会 | － | － | 10,500 | 2018/11/9 | 2019/5/10 | 233,539.0 | 10,500.14 | | 0.0000% | 4.5193% | | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国庫短期証券買入 | 1,000 | 2018/10/31 | | | 5,332 | 1,004 | 0.000 | | 0.003 | 2.0 |
| 国債買入（残存期間1年超3年以下） | 3,000 | 2018/10/31 | | | 8,990 | 3,006 | ▲0.003 | | ▲0.002 | 61.2 |
| 国債買入（残存期間3年超5年以下） | 3,500 | 2018/10/31 | | | 9,183 | 3,504 | ▲0.003 | | ▲0.002 | 49.6 |
| 国債買入（残存期間10年超25年以下） | 1,800 | 2018/10/31 | | | 7,851 | 1,800 | | 0.004 | 0.004 | |
| 国債買入（残存期間25年超） | 500 | 2018/10/31 | | | 2,310 | 503 | ▲0.005 | | ▲0.003 | 30.0 |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分） | 52,956 | 2018/10/30 | 2018/10/31 | | 433 | 433 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |
| 米ドル資金供給 | | 2018/11/1 | 2018/11/8 | 2.7 | 0 | 0 | | | | |

## ●2018年10月31日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合（2日目、終了後直ちに結果公表）
*黒田日銀総裁、定例会見　*経済・物価情勢の展望
*9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報（市場予想：前月比▲0.3%）
*9月の住宅着工統計　*10月の消費動向調査
*米国10月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏10月の消費者物価指数速報値

◆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。
◆本資料は何ら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論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