

Central Daily Market Report

2018年10月31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31日		2018年11月1日		2018年11月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 3,400		▲ 29,000		▲ 25,000	
資金過不足	▲ 3,400		▲ 29,800		▲ 26,000	
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	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				
E T F買入	900					
国債補完供給	▲ 200	400		200		
当増増減	7,800		▲ 29,600		▲ 26,000	
当座預金残高	3,970,300		3,940,700		3,914,700	
準備預金残高	3,464,500					
積み終了先	3,463,700				11月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,463,700				積数	
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					3,102,700	
準備預金進捗率	実績	99.82%	日数	51.61%		

●2018年10月31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~▲0.050%での調達で始まった。一巡後には▲0.050%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~▲0.030%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(10/31-11/1)は▲0.120~▲0.100%程度の出合い。T/N(11/1-11/2)は▲0.155~▲0.120%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、3M物が▲0.32%、6M物が▲0.21~▲0.205%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、案件の数は少なかったが、前日同様ノンバンクから大口発行が実施され、200億円弱の償還総額に対して、1,700億円弱の発行総額となった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2018/10/31	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	▲ 0.068				-	▲ 0.125	0.121	0.006	21,920.46	463.17	113.06-08	113.19-21
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.136						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.137						
2W	▲ 0.047	▲ 0.030	▲ 0.037				-	▲ 0.137						
3W							-	▲ 0.139						
1M	▲ 0.025	0.010	▲ 0.010				-	▲ 0.142						
3M			▲ 0.030				▲ 0.320	▲ 0.150						
6M							▲ 0.210	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.169	▲ 0.159						
									日付	10/24	10/25	10/26	10/29	10/30
									日銀当預残	3,945,000	3,953,900	3,954,700	3,966,100	3,962,500
									準備預金残	3,434,400	3,455,800	3,453,700	3,461,100	3,456,700
									マネタリーベース	5,040,900	5,051,400	5,053,000	5,064,300	5,061,100
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.069%	▲0.071%	▲0.070%	▲0.072%
									コール市場残高	117,414	101,683	103,807	98,295	96,176
									うち無担	103,314	87,272	89,676	84,109	81,957
									うちO/N	66,479	54,057	55,911	50,344	49,212
									うち有担	14,100	14,411	14,131	14,186	14,219

●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	オフター額(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(午前オフター分)	53,029	2018/10/31	2018/11/1		146	146		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月1日の予定

*英中銀MPC結果発表	*米国9月の建設支出	*10年利付国債入札(22,000億円、11/2発行)
	*米国10月のISM製造業景況指数	

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。

(1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2)

短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて

上下にある程度変動しうるものとし(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する)、

買入れ額については、保有残高の増加額年間約80兆円をめどとしつつ、弾力的な買入れを実施する。

(2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)

①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。

その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうるものとする。

②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

◆本資料は信頼できるとさ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