

Central Daily Market Report

2018年10月17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17日		2018年10月18日		2018年10月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 20,500		600		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 20,700		▲ 500		▲ 6,000	
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			12,400			
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					100	▲ 100
社債等買入						
E T F買入	100		100			
国債補充供給	▲ 1,300	1,900		1,300		
当預増減	▲ 19,100		13,200		▲ 6,000	
当座預金残高	3,949,000		3,962,200		3,956,200	
準備預金残高	3,454,800					
積み終了先	3,349,900					
超過準備	2,988,900				10月18日以降の残り所要積立額 積数 120,200	
非準備預金先	494,200				1日平均 4,100	
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		96.13%		日数 6.45%	

●2018年10月17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▲0.080~▲0.030%での調達で始まった。一巡後には▲0.080%程度の出合いが見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.030~▲0.025%程度での出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(10/17-10/18)は▲0.145~▲0.10%程度、T/N(10/18-10/19)は▲0.145~▲0.11%程度で出合いが見られた。引き続き調達サイドに厚みが無く、レートは低位で推移した。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10Y340~350や、5Y126、129、130、131、135、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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に1Y物で▲0.175%、1Y物のWI取引で▲0.179%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、鉄鋼業態でまとまった額の発行がみられ、発行総額は750億円程度と償還総額350億円程度を上回った。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

2018/10/17	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	▲ 0.061				-	▲ 0.109	0.143	▲ 0.002	22,841.12	291.88	112.34-35	112.23-24
T/N			0.000				-	▲ 0.139						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.030				-	▲ 0.141						
2W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.031				-	▲ 0.146						
3W			0.000				-	▲ 0.142						
1M	▲ 0.023	▲ 0.015	▲ 0.016				-	▲ 0.144						
3M			0.070				▲ 0.290	▲ 0.150						
6M							▲ 0.188	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.157						
									日付	10/10	10/11	10/12	10/15	10/16
									日銀当預残	3,872,100	3,876,800	3,874,400	3,966,300	3,968,100
									準備預金残	3,404,000	3,399,800	3,394,800	3,482,100	3,470,900
									マネタリーベース	4,965,300	4,970,100	4,967,600	5,059,200	5,060,900
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.050%	▲0.042%	▲0.039%	▲0.058%
									コール市場残高	109,144	109,158	110,871	117,667	107,935
									うち無担	84,413	88,068	89,025	94,871	91,572
									うちO/N	53,408	57,413	58,260	64,736	60,237
									うち有担	24,731	21,090	21,846	22,796	16,363

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2018/10/25	2019/4/26	224,459.0	10,500.14		0.0000%	4.6780%		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	応募総額(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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2018/10/18			10,966	3,009	0.002		0.003	18.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/10/18			7,771	3,510	0.000		0.001	17.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/10/18			12,353	4,517	0.000		0.001	36.8
国債買入(変動利付債)	1,000	2018/10/18			2,745	1,002	▲0.180		▲0.197	57.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	56,719	2018/10/17	2018/10/18		1,273	1,273		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,894	2018/10/17	2018/10/18		1	1		▲0.600	▲0.600	

●2018年10月18日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート(=地域経済報告)	*国庫短期証券(790回)入札 (1年、21,000億円、10/22発行)	*20年利付国債入札 (10,000億円、10/19発行)
*9月の貿易統計		

◆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