

Money Market

(マネーマーケット版)

(無断コピー、およびファックスでの転送は禁じます)

2010年(平成22年)

10月13日(水)第1234号

三菱UFJMSが7791億円を落札

3カ月短国落札結果

きょう実施の第144回3カ月短国(払込日10月18日、償還日2011年1月24日)の入札では、発行予定額4兆8220億円程度に対し、応札額が29兆2868億円、落札額が4兆8218億8000万円(第1非価格競争を含む)となった。足切り価格は99円97銭1厘5毛(利回り0・1061%)、平均価格は99円97銭1厘7毛(利回り0・1054%)、案分比率は21・3251%。
このうち、大量落札された機関は、三菱UFJMS791億円、大和証券CM7491億円、野村証7222億円、ドイツ証3975億円、みずほ証3790億円、RBS2869億円など。

20日に3カ月短国の入札

財務省は、来週20日に3カ月物短国の入札を実施すると発表した。発行予定額は4兆8000億円程度、発行予定日は10月25日、償還予定日は11年1月31日。(W)

福岡県10年債が条件決定

▼福岡県平成22年度第5回公募債①発行額100億円
②幹事大和証券CM、三菱UFJMS③期間10年(償還日20年10月28日)④利率0・94%(応募者利回り0・941%)⑤スプレッドJGB第311回債プラス6bp⑥発行価格99円97銭⑦募集13日⑧払込日28日⑨受託福岡⑩格付けAa2(MDY)⑪手数料32・5銭⑫各公債の

国債買入れ消却入札

予定額 700億円程度
受渡日 10/18

都銀	0
みずほ銀	0
三井住友	0
三菱東京UFJ	—
証券	0
野村証	—
大和CM	—
三菱UFJ	—
みずほ	—
外資系証	0
シティグループ	—
Mスタンレー	—
Gサクス	0
クレディ・スイス	—
メルリンチ日本	0
BNPパリバ	—
JPモルガン	—
ドレクナーKW	—
UBS	—
パークレイズ	—
ドイツ	—
不明	-680
応札額	1948億円
落札額	680億円
足切り	-05銭
平均	-13銭7厘
案分	はなし

10月13日の日本円TIBORレート

単位:%、速報値

1カ月	0.18000	7カ月	0.46462
2カ月	0.26000	8カ月	0.47000
3カ月	0.34615	9カ月	0.47385
4カ月	0.37769	10カ月	0.47692
5カ月	0.41769	11カ月	0.48154
6カ月	0.45385	12カ月	0.48462

全銀協公認

10月13日のユーロ円TIBORレート

単位:%、速報値

1カ月	0.17846	7カ月	0.46462
2カ月	0.25615	8カ月	0.47462
3カ月	0.34154	9カ月	0.48231
4カ月	0.37231	10カ月	0.49077
5カ月	0.41462	11カ月	0.49769
6カ月	0.45000	12カ月	0.50385

全銀協公認

東京都は10月10年債(融合方式)のマーケティングを開始。マーケティング・レンジは、第311回10年国債プラス4・5〜6bp。条件決定日は15日前引けを予定。(F)
◆鉄道・運輸機構が10年債を追加◆
鉄道建設・運輸施設整備支援機構は13日、次回起債予定の第34回4年債(350億円程度)に加え、第35回10年債(100億円程度)を追加すると発表。主幹事はみずほ(事務)、大和証券CM、野村。起債時期は11月を予定。(Z)

◆都10年債のマーケティングを開始◆
東京都は10月10年債の共同主幹事に日興C.O.(事務)、東海東京、野村を指名。起債時期は10月以降、発行額は未定。

◆横浜市、次回10年債のマーケティングを開始◆
横浜市は、次回10年債の主幹事マーケティングを開始。マーケティング・レンジは、第311回10年国債プラス7・8・5bp。条件決定日は19日を予定。発行額は200億円程度。主幹事は日興C.O.(事務)、および大和証券CM。次回債は機動型(スポット債)として実施。

◆大阪市、次回20年債の主幹事を指名◆
大阪市は、次回20年債の共同主幹事に日興C.O.(事務)、東海東京、野村を指名。起債時期は10月以降、発行額は未定。

◆日本高速道路保有・債務返済機構第121回債(政府保証債)①発行額300億円②事務幹事日興C.O.③期間20年(償還日・30年10月31日)④利率1・8%⑤スプレッド

⑥発行価格100円⑦募集13日⑧払込日26日⑨発行・支払代理人・受託三井住友銀⑩格付け⑪手数料35銭⑫各債券の金額1億円⑬利払い4月と10月の各20日

金額10万円⑬利払日4月と10月の各28日

◆高速道路機構政保債が条件決定◆

金額10万円⑬利払日4月と10月の各28日

3カ月短国落札結果

第144回
発行予定額 4兆8220億円

払込日 2010/10/18
償還日 2011/01/24

都銀	0.0	証券	27843.5
みずほ銀	—	野村証	7222.0
みずほC銀	0.0	大和証券CM	7491.9
三井住友	0.0	日興C.O.	426.5
三菱UFJ銀	—	三菱UFJMS	7791.0
りそな銀	0.0	みずほバ	270.2
長信銀	0.0	岡三証	345.0
新生銀	—	コスモ証	0.0
あおぞら	0.0	SMBCフレド	0.0
系統	0.0	東海東京	506.9
農中	—	丸三証	0.0
信金中金	0.0	水戸証	0.0
信託	0.0	東洋証	0.0
三菱UFJ信	0.0	かざか証	0.0
住友信	0.0	極東証	0.0
みずほ信	0.0	日の出証	0.0
中央三井	0.0	みずほ証	3790.0
地銀	0.0	しんきん	0.0
横浜銀	0.0	外資系証	9429.6
千葉銀	0.0	シティグループ	—
北陸銀	0.0	MSMUG	0.0
静岡銀	0.0	Gサクス	—
常陽銀	0.0	Cスイス	281.6
福岡銀	0.0	メル日本	—
千葉興銀	0.0	BNPパリバ	213.2
第四銀	0.0	JPモルガン	764.0
八十二銀	0.0	Cアグリコル	286.2
西日本ティ	0.0	パークレイズ	870.0
七十七銀	0.0	ドイツ	3975.0
群馬銀	0.0	UBS	0.0
大垣共立	0.0	ウエストエルベ	0.0
中国銀	0.0	ドレクナーKW	0.0
生損保	0.0	HSBC	0.0
日生	—	RBS	2869.0
第一生	—	ソシエティエナ	170.6
明治安田	—	外資系銀	0.0
朝日生	0.0	ドレクナー	0.0
東京海日動	0.0	ウエストエルベ	0.0
三井住友海	0.0	ドイツ	0.0
損保ジャパン	0.0	不明	-10945.7
短資	0.0	応札額	29兆2868.0億円
東京	0.0	落札額	4兆8218.8億円
上田	0.0	足切り	99円97銭1厘5毛
セントラル	0.0	最高利回り	0.1061%
		平均	99円97銭1厘7毛
		平均利回り	0.1054%
		案分	21.3251%

※落札額には第1非価格競争分を含む

(2)
(1)

※過去記事検索はFN Webで

無断コピーおよび転送は固くお断りしております

三菱東京UFJ銀行 対顧客(Openin、各通貨当たり円)

☆直物電信売買相場[13日] ☆期限付手形買相場[13日]

	TTS	TTB		30d/s	60d/s	90d/s	120d/s	150d/s
US. \$	82.83	80.83	US. \$	80.53	80.32	80.10	79.88	79.67
EUR	115.50	112.50	EUR	112.00	111.68	111.34	110.98	110.66
CAN. \$	82.61	79.41	CAN. \$	79.00	78.73	78.44	78.15	77.89
STG. ￠	133.09	125.09	STG. ￠	124.54	124.19	123.81	123.44	123.09
S. FR	86.39	84.59	S. FR	84.27	84.07	83.86	83.65	83.44
D. KR	15.59	14.99	D. KR	14.92	14.87	14.83	14.78	14.74
N. KR	14.29	13.69	N. KR	13.59	13.53	13.47	13.41	13.36
S. KR	12.70	11.90	S. KR	11.83	11.79	11.74	11.70	11.66
A. \$	82.74	78.74	A. \$	77.99	77.49	76.94	76.45	75.96
NZ. \$	63.85	59.85						
RMB. ¥	n. a.	~ n. a.						
HK. \$	10.98	10.12						
M. R	n. a.	~ n. a.						

☆先物相場(\$50,000まで) S:SELLING B:BUYING

	*暦月制	10月	11月	12月	1月	2月	3月
\$ S	82.83	82.83	82.82	82.79	82.77	82.74	
B	80.80	80.77	80.73	80.68	80.65	80.62	
￠ S	133.09	133.09	133.07	132.99	132.93	132.87	
B	125.02	124.91	124.81	124.71	124.63	124.53	
EUR S	115.50	115.50	115.48	115.41	115.35	115.28	
B	112.43	112.33	112.25	112.14	112.05	111.96	

	*確定日	11/15	12/15	1/17	2/15	3/15	4/15
\$ S	82.83	82.82	82.78	82.76	82.73	82.69	
B	80.78	80.75	80.70	80.67	80.63	80.60	
￠ S	133.09	133.05	132.95	132.90	132.83	132.74	
B	124.95	124.87	124.75	124.68	124.58	124.50	
EUR S	115.50	115.46	115.37	115.32	115.24	115.15	
B	112.37	112.30	112.19	112.10	112.01	111.93	

外為銀行貿易金利

手形取立期間立替金利の変更

	[13日]	変更日
US. \$	12	0 10/5
CAN. \$	15	0 9/22
STG. ￠	23	0 9/22
S. FR	13	0 9/22
D. KR	3	0 2/3
N. KR	4	0 8/19
S. KR	3	0 9/1
A. \$	25	-1 10/13
NZ. \$	16	0 9/22
RMB		
HK. \$	2	0 11/26
M. R		
S. \$	10	0 9/22
S. P #		
ECU		
S. R	4	0 6/17
EUR	20	+1 10/13

#:per 100 unit

貿易金利 ()は前日比

◆米国BALレト(年%)

3M/S	0.6250	(0.0000)
4M/S	0.7500	(0.0000)

◇ドル輸出入ユーザ ンス金利(年%以下)

	[13日]	輸入	輸出
L/C付 3M/S		3.1250	
6M/S		3.2500	3.2500
L/C無 3M/S		3.3750	D/P, D/A
6M/S		3.5000	4.0000

◇その他通貨輸入ユーザ ンス金利(年率%)

	[13日]	CAN. \$	￠	S. FR	D. KR
3M/S	4.2500	3.6250	2.8750	3.5000	
6M/S	4.3750	3.7500	3.0000	3.6250	
		N. KR	S. KR	EUR	
3M/S	5.2500	4.3750	3.6250		
6M/S	5.3750	4.5000	3.7500		

◇ 円為替対コリス金利(海外業者負担金利、年%)

円建輸出ユーザ ンス金利(他に引受手数料1.5%)

L/C付・邦銀引受条件付	ドル建	1.475
L/C付・邦銀引受条件無	ドル建	2.225
円建オートラフト・メールクレジット		-3.275

※過去記事検索はFN Webで (Z・Z)

(2) (2)