

Central Daily Market Report

2018年11月1日(木)
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11月1日		2018年11月2日		2018年11月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 500		2,000	
財政	▲ 28,500		▲ 31,100		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 29,300		▲ 31,600		0	
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						▲ 1,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入				100		
国債補完供給	▲ 900	200		900		
当預増減	▲ 30,000		▲ 30,700		▲ 1,500	
当座預金残高	3,940,300		3,909,600		3,908,100	
準備預金残高	3,449,200					
積み終了先	3,448,600				11月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,448,600				積数 5,000	
非準備預金先	491,100				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		99.84%		日数 54.84%	

●2018年11月1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・証券業態を中心に▲0.086~▲0.050%の出合いとなった。月末要因が剥落したものの、さほど資金調達サイドに厚みは見られず昨日比横ばいの動きとなった。ターム物に関しては特段目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(11/1-11/2)は▲0.120~▲0.100%程度の出合い。T/N(11/2-11/5)は▲0.150~▲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▲0.325~▲0.32%、6M物が▲0.23%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、案件が少なかったが、ノンバンク等から大型発行が実施され、償還総額100億円程度に対して、900億円強の発行総額となった。発行レートに特段の変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/11/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.139	0.120	▲ 0.001	21,687.65	▲ 232.81	112.85-86	112.89-91
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.146						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.148						
2W			▲ 0.033				-	▲ 0.146						
3W							-	▲ 0.146						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.148						
3M							▲ 0.320	▲ 0.153						
6M							▲ 0.229	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.169	▲ 0.159						
									日付	10/25	10/26	10/29	10/30	10/31
									日銀当預残	3,953,900	3,954,700	3,966,100	3,962,500	3,970,300
									準備預金残	3,455,800	3,453,700	3,461,100	3,456,700	3,464,500
									マナタリーベース	5,051,400	5,053,000	5,064,300	5,061,100	5,068,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.069%	▲ 0.071%	▲ 0.070%	▲ 0.072%	▲ 0.068%
									コール市場残高	101,683	103,807	98,295	96,176	78,500
									うち無担	87,272	89,676	84,109	81,957	66,848
									うちO/N	54,057	55,911	50,344	49,212	34,528
									うち有担	14,411	14,131	14,186	14,219	11,652

●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)
10年利付国債	352	0.10%	22,000	2018/11/2	2028/9/20	76,630.0	17,699.00	99.6300	0.1370%	12.9543%	99.6500	0.1350%	4,287.0

●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	入札総額(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)	173,945	2018/11/1	2018/11/2		777	777		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	6,739	2018/11/1	2018/11/2		7	7		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月2日の予定

- *10月実績/11月見込み財政資金対民間収支
- *10月のマナタリーベース
- *米国9月の貿易収支
- *米国9月の製造業新規受注・出荷・在庫
- *米国10月の雇用統計
- *国庫短期証券(793回)入札(3ヶ月、43,000億円、11/5発行)

◆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お客様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