

Central Daily Market Report

2018年11月2日(金)

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2日		2018年11月5日		2018年11月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		1,000		1,000	
財政	▲ 32,500		▲ 3,500		2,000	
資金過不足	▲ 32,900		▲ 2,500		3,000	
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			1,800	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,200			
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						
社債等買入						
E T F買入	100					
国債補完供給	▲ 200	900		200		
当預増減	▲ 32,200		10,100		3,000	
当座預金残高	3,908,100		3,918,200		3,921,200	
準備預金残高	3,426,800					
積み終了先	3,426,200					
超過準備	3,426,200					
非準備預金先	481,300					
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	99.90%	日数	64.52%		

●2018年11月2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%の出会いとなった。税揚げ、普通交付税の払い日に当たる週末の取引となったものの、大きく取りあがる動きはなかった。一巡後は▲0.085~▲0.065%で調整の出会いが見られた。ターム物に関してはショートタームで▲0.038%の出会い。共通担保資金供給オペは8,000億円(11/5~11/19)オファーされ、応札額1,763億円(期落ち分1,502億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(11/2-11/5)は▲0.120~▲0.100%程度の出合い。T/N(11/5-11/6)は▲0.130~▲0.105%程度の出合い。T/Nは短国の発行要因から、前日に比べてレートを切り上げた。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は小幅上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において一時▲0.35%の出合いが見られたものの、その後は▲0.30%まで売られる展開となる中、平均落札利回▲0.2980%、按分落札利回▲0.2836%と、引き続き低いレート水準での決着となった。セカンダリーでは、▲0.315%の出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は、償還も小規模であったため、案件数、金額ともに少なく、閑散としたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2018/11/2	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	▲ 0.071				-	▲ 0.115	0.125	0.005	22,243.66	556.01	112.72-74	112.96-97
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.142						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.046	0.000	▲ 0.032				-	▲ 0.143						
2W	▲ 0.040	▲ 0.037	▲ 0.038				-	▲ 0.144						
3W							-	▲ 0.144						
1M							-	▲ 0.147						
3M							▲ 0.315	▲ 0.152						
6M							▲ 0.230	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.169	▲ 0.159						
									日付	10/26	10/29	10/30	10/31	11/1
									日銀当預残	3,954,700	3,966,100	3,962,500	3,970,300	3,940,300
									準備預金残	3,453,700	3,461,100	3,456,700	3,464,500	3,449,200
									マネタリーベース	5,053,000	5,064,300	5,061,100	5,068,800	5,039,700
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.070%	▲0.072%	▲0.068%	▲0.071%
									コール市場残高	103,807	98,295	96,176	78,500	100,619
									うち無担	89,676	84,109	81,957	66,848	86,584
									うちO/N	55,911	50,344	49,212	34,528	54,064
									うち有担	14,131	14,186	14,219	11,652	14,035

●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)
国庫短期証券	793	-	43,000	2018/11/5	2019/2/12	133,291.0	34,922.6	100.0770	▲0.2836%	10.9941%	100.0809	▲0.2980%	8,077.0

●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	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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/11/5	2018/11/19		1,763	1,763				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2018/11/5			10,063	3,505	▲0.006		▲0.004	22.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2018/11/5			10,434	4,005	▲0.004		▲0.003	95.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/11/5			10,978	4,505	▲0.006		▲0.004	29.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	73,434	2018/11/2	2018/11/5		190	190		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月5日の予定

*黒田日銀総裁、名古屋での経済界代表者との懇談にて講演
*金融政策決定会合議事要旨(9月18、19日分)
*11月の日銀当座預金増減要因見込み

*米国10月のISM非製造業景況指数

◆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