

Central Daily Market Report

2018年11月5日(月)
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5日		2018年11月6日		2018年11月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		700		1,000	
財政	▲ 3,500		700		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 2,600		1,400		▲ 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		3,100			
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				▲ 100		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 400	200		400		
当預増減	9,600		4,800		▲ 3,000	
当座預金残高	3,917,700		3,922,500		3,919,500	
準備預金残高	3,433,100					
積み終了先	3,432,600		11月6日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,432,600		積数		2,700	
非準備預金先	484,600		1日平均		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		99.91%		日数	
					67.74%	

●2018年11月5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%の出会いとなった。先週に続き取り手が少なく、一巡後はオファー残りの場面が散見された。午後は▲0.086%で調整の出会いが見られた程度であった。ターム物に関してはショートタームで▲0.045~▲0.035%の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(11/5-11/6)は▲0.120~▲0.100%程度 of 出会い。T/N(11/6-11/7)は▲0.130~▲0.120%程度 of 出会い。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、引け際に3M物が▲0.312~▲0.31%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、案件少なく閑散であったが、ノンバンク業態から大型案件が見られ発行総額は1,000億円程度であった(償還総額300億円程度)。発行レートは0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/11/5	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.113	0.125	0.000	21,898.99	▲ 344.67	113.13-15	113.18-19
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.131						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.042				-	▲ 0.134						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.136						
3W							-	▲ 0.139						
1M							-	▲ 0.143						
3M							▲ 0.310	▲ 0.150						
6M							▲ 0.230	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.169	▲ 0.158						
									日付	10/29	10/30	10/31	11/1	11/2
									日銀当預残	3,966,100	3,962,500	3,970,300	3,940,300	3,908,100
									準備預金残	3,461,100	3,456,700	3,464,500	3,449,200	3,426,300
									マネタリーベース	5,064,300	5,061,100	5,068,800	5,039,700	5,007,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.070%	▲ 0.072%	▲ 0.068%	▲ 0.071%	▲ 0.071%
									コール市場残高	98,295	96,176	78,500	100,619	109,205
									うち無担	84,109	81,957	66,848	86,584	91,293
									うちO/N	50,344	49,212	34,528	54,064	56,623
									うち有担	14,186	14,219	11,652	14,035	17,912

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/11/6			2,089	500		0.021	0.021	
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/11/6			5,715	1,806	0.004		0.004	69.6
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/11/6			1,783	508	0.006		0.007	10.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	89,054	2018/11/5	2018/11/6		338	338		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	38,180	2018/11/5	2018/11/6		8	8		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年11月6日の予定

*9月の全世帯家計調査	*10年物価連動国債入札(4,000億円、11/7発行)
-------------	------------------------------

◆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