

# Central Daily Market Report

2018年11月6日(火)  
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6日 需給速報	2018年11月7日 需給予想	2018年11月8日 当社予想
銀行券	800	700	0
財政	1,100	▲ 3,500	2,000
資金過不足	1,900	▲ 2,800	2,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
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	3,100		
CP等買入			
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	▲ 100	400	100
当預増減	5,200	▲ 1,700	2,000
当座預金残高	3,922,900	3,921,200	3,923,200
準備預金残高	3,439,100		
積み終了先	3,438,500		11月7日以降の残り所要積立額
超過準備	3,438,500		積数
非準備預金先	483,800		1日平均
			200
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	99.93%	日数
			70.97%

## ●2018年11月6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。一巡後は調達サイドの目途が付き、閑散とした中、▲0.086%で調整の出会いが見られた。ターム物に関してはロール案件中心で目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T+0(11/6-11/7)は▲0.110~▲0.090%程度 of 出会い。T/N(11/7-11/8)は▲0.150~▲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は小幅低下した。アウトライト市場では、短国買入オペが1,000億円(前回と同額)でオファーされた。引き続き買入額が少額にとどまる中、全取落札利回較差+0.015%、平均落札利回較差+0.015%と在庫調整の売りからか、弱い結果となった。オペの弱い結果を受けて、マーケットでは、3M物が▲0.305~▲0.30%出会いと軟調に推移した。

### <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、鉄鋼業態から大型案件が見られたものの、案件少なく発行総額は700億円程度であった(償還総額500億円程度)。発行レートは引き続き0%近辺が中心であった。本日はCP等買入オペが事前予定通り2,000億円程度でオファーされた。結果は、按分落札レート▲0.002% 平均落札レート▲0.002%と、前回(按分▲0.002% 平均0.002%)から平均レートが低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/11/6	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				-	▲ 0.118	0.125	0.000	22,147.75	248.76	113.26-27	113.33-34
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.142						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.142						
2W							-	▲ 0.142						
3W							-	▲ 0.144						
1M							-	▲ 0.147						
3M							▲ 0.300	▲ 0.153						
6M							▲ 0.230	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.159						
									日付	10/30	10/31	11/1	11/2	11/5
									日銀当預残	3,962,500	3,970,300	3,940,300	3,908,100	3,917,700
									準備預金残	3,456,700	3,464,500	3,449,200	3,426,300	3,432,800
									マネタリーベース	5,061,100	5,068,800	5,039,700	5,007,900	5,016,700
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.068%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.072%
									コール市場残高	96,176	78,500	100,619	109,205	93,410
									うち無担	81,957	66,848	86,584	91,293	76,599
									うちO/N	49,212	34,528	54,064	56,623	42,029
									うち有担	14,219	11,652	14,035	17,912	16,811

## ●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)
物価連動10年	23	0.10%	4,000	2018/11/7	2028/3/10	14,799.0	3,995.00	103.9000	▲0.3050%	43.0272%			

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2018/11/7			9,252	1,000		0.015	0.015	
CP等買入	2,000	2018/11/9			4,650	1,960	▲0.002		▲0.002	85.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	69,135	2018/11/6	2018/11/7		71	71		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/11/8	2018/11/16	2.7	0	0				

## ●2018年11月7日の予定

*布野日銀審議委員、高知県金融経済懇談会にて講演	*米国FOMC(1日目)	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/15借入)
*9月の毎月勤労統計調査速報	*米国9月の消費者信用残高	
*9月の景気動向指数速報		
*10月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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