Central Daily Market Report

2018年11月8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8日 需給速報		2018年11月9日 需給予想		2018年11月12日 当社予想	
銀行券	▲ 200		400		1,000	
財政	2,300		▲ 4,800		▲ 7,000	
資金過不足	2,100		▲ 4,400		▲ 6,000	
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						▲ 2,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100	2,000	▲ 200		
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		1,000			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	2,000		▲ 1,500		▲ 8,100	

当座預金残高	3,922,900	3,921,400	3,913,300
準備預金残高	3,442,900		
積み終了先	3,442,800		
超過準備	3,442,400		
非準備預金先	480,000		

11月9日以降の残り所要積立額	
積数	800
1日平均	100

積み期間（10/16～11/15）の所要準備額			3,105,100
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数 77.42%

●2018年11月8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%の出合いとなった。地銀業態を中心に調整に動く先が散見されたものの、総じてみると取り手の層が薄く、出合い一巡後は閑散であった。タ－ム物はロール案件中心で目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(11/8-11/9)は▲0.110～▲0.100%程度の出合い。T/N(11/9-11/12)は▲0.130～▲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。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.19～▲0.185%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1894%、按分落札利回▲0.1833%と平均落札利回は前回債から上昇したものの、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、▲0.20～▲0.195%の出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.29～▲0.285%、1Y物が▲0.17%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。発行市場は少額の発行案件が多く、発行総額300億円程度であった（償還総額2,000億円程度）。発行レートは引き続き0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/11/8	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.071				－	▲ 0.114
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.137
S/N							－	－
1W			▲ 0.046				－	▲ 0.141
2W							－	▲ 0.143
3W							－	▲ 0.146
1M							－	▲ 0.149
3M			▲ 0.045				▲ 0.285	▲ 0.153
6M							▲ 0.200	▲ 0.152
1Y							▲ 0.170	▲ 0.159

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.120	0.000	22,486.92	401.12	113.56-57	113.69-71

日付	11/1	11/2	11/5	11/6	11/7
日銀当預残	3,940,300	3,908,100	3,917,700	3,922,900	3,920,900
準備預金残	3,449,200	3,426,300	3,432,800	3,439,100	3,436,100
マネタリーベース	5,039,700	5,007,900	5,016,700	5,021,100	5,018,400
無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.071%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.070%
コール市場残高	100,619	109,205	93,410	89,153	91,190
うち無担	86,584	91,293	76,599	74,887	76,207
うちO/N	54,064	56,623	42,029	42,547	42,017
うち有担	14,035	17,912	16,811	14,266	14,983

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	794	－	23,000	2018/11/12	2019/5/10	101,720.0	18,887.7	100.0900	▲0.1833%	27.2688%	100.0930	▲0.1894%	4,112.0
流動性供給	273	－	4,000	2018/11/9		22,676.0	3,987.0		▲0.0030%	2.2153%		▲0.0050%	

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	41,485	2018/11/8	2018/11/9		58	58		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月9日の予定

*10月のマネーストック
*米国9月の卸売売上高
*米国10月の生産者物価指数
*米国11月のミシガン大消費者信頼感指数速報
*英国7-9月期のGDP速報値
*国庫短期証券（795回）入札
（3ヶ月、43,000億円、11/12発行）
*エネルギー対策借入
（6,000億円、11/20借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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