

Central Daily Market Report

2018年11月12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12日		2018年11月13日		2018年11月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		300		0	
財政	▲ 10,300		▲ 2,000		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 9,500		▲ 1,700		▲ 7,000	
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	2,200	▲ 2,100				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,000		4,900			
CP等買入		▲ 200		▲ 600		
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	300					
国債補充供給	▲ 2,800		2,800			
当増減	▲ 2,100		5,400		▲ 7,000	
当座預金残高	3,917,600		3,923,000		3,916,000	
準備預金残高	3,436,700					
積み終了先	3,436,600		11月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,436,600		積数		300	
非準備預金先	480,900		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	99.99%	日数	90.32%		

●2018年11月12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%と横ばい圏の出合いとなった。一巡後は▲0.070%程度で調整の出合いが見られていた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.045~▲0.035%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(11/12-11/13)は▲0.200~▲0.120%程度の出合い。T/N(11/13-11/14)は▲0.230~▲0.180%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、30Y59~60、40Y11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)は低下した。アウトライト市場は、特段の材料がない中、3M物が▲0.245%、6M物が▲0.24~▲0.21%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,100億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と若干の償還超であった。一部の石油業態において大型案件が見られたものの、案件数少なく落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/11/12	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			
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)		
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.070				-	▲ 0.149	0.115	▲ 0.005	22,269.88	19.63	113.83-85	114.16-18		
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.200								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.045	▲ 0.028	▲ 0.037				-	▲ 0.185								
2W							-	▲ 0.173								
3W							-	▲ 0.167								
1M							-	▲ 0.167								
3M							▲ 0.245	▲ 0.161								
6M							▲ 0.240	▲ 0.155								
1Y							▲ 0.170	▲ 0.160								
											日付	11/5	11/6	11/7	11/8	11/9
											日銀当預残	3,917,700	3,922,900	3,920,900	3,922,900	3,919,700
											準備預金残	3,432,800	3,439,100	3,436,100	3,444,000	3,437,400
											マネタリーベース	5,016,700	5,021,100	5,018,400	5,020,600	5,016,800
											無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.071%	▲0.070%	▲0.071%	▲0.071%
											コール市場残高	93,410	89,153	91,190	104,800	99,432
											うち無担	76,599	74,887	76,207	84,738	85,934
											うちO/N	42,029	42,547	42,017	43,118	43,044
											うち有担	16,811	14,266	14,983	20,062	13,498

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第I非償還競争入札(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)	着札総額(億円・百万ドル)	投分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均着札レート・利回較差・価格較差	投分比率
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/11/13			13,133	4,515	▲0.004		▲0.004	73.6
国債買入(物価連動債)	250	2018/11/13			1,373	251	▲0.070		▲0.086	76.2
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,236	2018/11/12	2018/11/13		2,613	2,613		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,000	2018/11/12	2018/11/13		78	78		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月13日の予定

*9月の特定サービス産業動態統計速報	*米国10月の財政収支	*30年利付国債入札(7,000億円、11/14発行)
		*交付税特別会計借入(10,500億円、11/22借入)

◆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よう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選ばれ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