

Central Daily Market Report

2018年11月13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13日		2018年11月14日		2018年11月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		1,000		0	
財政	▲ 2,000		▲ 7,600		8,000	
資金過不足	▲ 1,700		▲ 6,600		8,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入			1,000			
国債買入	4,900					
CP等買入		▲ 600		▲ 500		
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			1,100			
国債補充供給	▲ 1,500	2,800		1,500		
当預増減	3,900		▲ 3,500		8,000	
当座預金残高	3,921,500		3,918,000		3,926,000	
準備預金残高	3,421,500					
積み終了先	3,421,400				11月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,421,400				積数	
非準備預金先	500,000				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	
					93.55%	

●2018年11月13日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは邦銀を中心に▲0.086~▲0.050%が中心の出会いとなった。積み終盤に差し掛かっているため地銀業態中心に調整のビッドが散見されたものの、出会い一巡後は閑散。後場も特段の出会いは見られなかった。ターム物に関してはロール案件中心で特段目立った出会いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(11/13-11/14)は▲0.200~▲0.170%程度の出合い。T/N(11/14-11/15)は▲0.270~▲0.150%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、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)は低水準で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペアが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、按分落札利回較差+0.020%、平均落札利回較差+0.025%と、在庫調整の売りから弱い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.245~▲0.240%、6M物が▲0.235%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。CP発行市場は償還総額3,500億円程度に対して、発行総額は4,000億円程度と発行超であった。5・10日発行となり複数業態において大型案件が見られ活況な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。本日はCP等買入オペアが2,000億円オファーされた。入れ結果は平均落札レート0.001%・按分レート▲0.004%と、前回(平均▲0.002%・按分▲0.002%)比で平均落札レートは上昇し、按分レートは低下した。

●短期金融市場関連指標

2018/11/13	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	▲ 0.072				-	▲ 0.200	0.110	▲ 0.005	21,810.52	▲ 459.36	113.68-70	114.06-07
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.256						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.034				-	▲ 0.202						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.192						
3W							-	▲ 0.182						
1M							-	▲ 0.174						
3M							▲ 0.245	▲ 0.164						
6M							▲ 0.235	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.160						
									日付	11/6	11/7	11/8	11/9	11/12
									日銀当預残	3,922,900	3,920,900	3,922,900	3,919,700	3,917,600
									準備預金残	3,439,100	3,436,100	3,444,000	3,437,400	3,436,700
									マナタリーベース	5,021,100	5,018,400	5,020,600	5,016,800	5,013,900
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.070%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.070%
									コール市場残高	89,153	91,190	104,800	99,432	97,219
									うち無担	74,887	76,207	84,738	85,934	82,088
									うちO/N	42,547	42,017	43,118	43,044	46,298
									うち有担	14,266	14,983	20,062	13,498	15,131

●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)
30年利付国債	60	0.90%	7,000	2018/11/14	2048/9/20	22,443.0	5,630.00	100.5500	0.8760%	64.4188%	100.6000	0.8740%	1,360.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/11/22	2019/5/24	236,801.0	10,500.14		0.0000%	4.4342%		0.0000%	

●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	応募総額(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	2018/11/14			7,876	1,000	0.020		0.025	27.6
CP等買入	2,000	2018/11/16			3,675	1,997	▲0.004		0.001	60.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	46,328	2018/11/13	2018/11/14		1,425	1,425		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月14日の予定

*7-9月期のGDP1次速報(市場予想：前期比年率▲1.0%)
*9月の第3次産業活動指数

*米国10月の消費者物価指数
*ユーロ圏7-9月期のGDP2次速報
*英国10月の消費者物価指数

◆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