

●資金需給

単位：億円	2018年11月14日		2018年11月15日		2018年11月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		▲ 500		▲ 1,000	
財政	▲ 5,300		10,400		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 4,300		9,900		▲ 21,000	
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						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 500		2,000
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	▲ 1,400	1,500		1,400		
当預増減	▲ 2,600		10,800		▲ 19,000	
当座預金残高	3,918,900		3,929,700		3,910,700	
準備預金残高	3,418,600					
積み終了先	3,418,400					
超過準備	3,418,400					
非準備預金先	500,300					
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		100.00%		日数	
					96.77%	

●2018年11月14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%が中心の出会いと横ばい圏で推移した。朝方の出会い一巡後は閑散で、特段出合いは見られなかった。ターム物はショートタームで▲0.040%の出合いが見られた。また本日は3市場合同BCP訓練の一環として、固定金利方式による共通担保資金供給オペ(O/N)物が1,000億円オファーされ、49億円の落札となった。

＜レポ市場＞

GC T+0(11/14-11/15)は▲0.140～▲0.100%程度の出合い。T/N(11/15-11/16)は▲0.180～▲0.110%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、積みの最終調整の落ち着きからか、レート上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.245%、6M物が▲0.24%で出会った。

＜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100億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と発行超であった。一部の機械・石油業態において大型案件が見られやや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。

●短期金融市場関連指標

2018/11/14	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	▲ 0.067				-	▲ 0.131	0.105	▲ 0.005	21,846.48	35.96	113.79-80	113.89-90
T/N	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.178						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.032				-	▲ 0.172						
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.033				-	▲ 0.172						
3W							-	▲ 0.169						
1M			0.000				-	▲ 0.164						
3M							▲ 0.245	▲ 0.162						
6M							▲ 0.240	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.161						
									日付	11/7	11/8	11/9	11/12	11/13
									日銀当預残	3,920,900	3,922,900	3,919,700	3,917,600	3,921,500
									準備預金残	3,436,100	3,444,000	3,437,400	3,436,700	3,421,900
									マネタリーベース	5,018,400	5,020,600	5,016,800	5,013,900	5,017,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.070%	▲ 0.071%	▲ 0.071%	▲ 0.070%	▲ 0.072%
									コール市場残高	91,190	104,800	99,432	97,219	91,165
									うち無担	76,207	84,738	85,934	82,088	79,451
									うちO/N	42,017	43,118	43,044	46,298	45,891
									うち有担	14,983	20,062	13,498	15,131	11,714

●入札結果

名称	回数	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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	14,003	2018/11/14	2018/11/15		1,337	1,337		▲ 0.600	▲ 0.600	
米ドル資金供給		2018/11/16	2018/11/29	2.7	0	0				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉・即日	1,000	2018/11/14	2018/11/15		49	49				

●2018年11月15日の予定

*9月の石油等消費動態統計	*米国9月の企業在庫 *米国10月の小売売上高	*5年利付国債入札 (20,000億円、11/16発行) *国有林野借入 (776億円、11/26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