

# Central Daily Market Report

2018年11月15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15日		2018年11月16日		2018年11月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 500		0	
財政	12,200		▲ 22,500		▲ 2,000	
資金過不足	11,700		▲ 23,000		▲ 2,000	
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						▲ 1,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 500	2,000	▲ 100		
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			700			
国債補完供給	▲ 4,000	1,400		4,000		
当預増減	8,600		▲ 16,400		▲ 3,800	
当座預金残高	3,927,500		3,911,100		3,907,300	
準備預金残高	3,438,500					
積み終了先	3,438,500				11月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,438,400				積数 3,010,900	
非準備預金先	489,000				1日平均 100,400	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,010,900	
準備預金進捗率	実績		0.00%		日数 0.00%	

## ●2018年11月15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%の出合いとなった。積み最終日の取引となり調整のビッドが多く見られたことで出合いは膨らんだものの、全体的なレンジは変わらず、横ばい圏で推移した。午後▲0.080~▲0.065%で調整の出合いが見られた。ターム物はショートタームで▲0.045~▲0.030%の出合い。

### <レポ市場>

GC T+0(11/15-11/16)は▲0.120~▲0.100%程度の出合い。T/N(11/16-11/19)は▲0.130~▲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、新積み期に入り上昇した。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350億円程度に対して、発行総額は650億円程度と発行超であった。一部の鉄鋼業態において大型案件が見られたものの、案件数は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

2018/11/15	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	
	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	▲ 0.073				-	▲ 0.105	0.105	0.000	21,803.62	▲ 42.86	113.56-57	113.52-54
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.130						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.031				-	▲ 0.133						
2W	▲ 0.043	▲ 0.030	▲ 0.039				-	▲ 0.136						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.142						
1M	▲ 0.035	0.000	▲ 0.030				-	▲ 0.146						
3M							▲ 0.245	▲ 0.159						
6M							▲ 0.240	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.161						
									日付	11/8	11/9	11/12	11/13	11/14
									日銀当預残	3,922,900	3,919,700	3,917,600	3,921,500	3,918,900
									準備預金残	3,444,000	3,437,400	3,436,700	3,421,900	3,418,600
									マネタリーベース	5,020,600	5,016,800	5,013,900	5,017,500	5,014,000
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.071%	▲0.070%	▲0.072%	▲0.067%
									コール市場残高	104,800	99,432	97,219	91,165	90,591
									うち無担	84,738	85,934	82,088	79,451	74,293
									うちO/N	43,118	43,044	46,298	45,891	42,283
									うち有担	20,062	13,498	15,131	11,714	16,298

## ●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)
5年利付国債	137	0.10%	20,000	2018/11/16	2023/9/20	63,842.0	16,420.0	100.9100	▲0.0870%	68.1985%	100.9100	▲0.0870%	3,568.0
国有林野借入	-	-	776	2018/11/26	2023/11/25	2,879.0	776.00		0.0010%	100.0000%		0.0010%	

## ●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	入札総額(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)	206,365	2018/11/15	2018/11/16		3,804	3,804		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年11月16日の予定

*米国10月の鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(796回)入札
*ユーロ圏10月の消費者物価指数改定値	(3ヶ月、42,500億円、11/19発行)

◆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