

# Central Daily Market Report

2018年11月16日(金)

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16日		2018年11月19日		2018年11月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		200		▲ 1,000	
財政	▲ 23,500		▲ 3,700		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 24,100		▲ 3,500		▲ 2,000	
<b>金融調節</b>	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			1,500	▲ 1,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,100			
CP等買入	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						
E T F買入	700					
国債補完供給	▲ 700	4,000		700		
当預増減	▲ 18,200		4,000		▲ 2,000	
当座預金残高	3,909,300		3,913,300		3,911,300	
準備預金残高	3,422,400					
積み終了先	3,396,500					
超過準備	2,437,800					
非準備預金先	486,900					
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	98.10%	日数	10.00%		

## ●2018年11月16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。新しい積み期に入ったものの、昨日までの前積み期の流れを引き継ぎ、取り上がる雰囲気もなくレートは低下傾向となった。一巡後も▲0.080~▲0.050%のレンジで調整の出合いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.045~▲0.025%程度での出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(11/16-11/19)は▲0.180~▲0.110%程度の出合い。T/N(11/19-11/20)は▲0.160~▲0.130%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)は低下した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.29%から▲0.328%まで一時買い進まれたものの、その後▲0.30%近辺の気配で引ける展開となる中、平均落札利回▲0.2984%、按分落札利回▲0.2847%とWI取引の強めの出合いを反映し、前回債からレートは低下する強い結果となった。セカンダリーでは、引け際に▲0.33%出合いと強含みで推移した。この他に、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1,600億円程度に対して、発行総額は1,700億円程度と若干の発行超であった。一部の輸送機器業態においては大型案件が見られたものの、全般的には小型案件を中心とする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

2018/11/16	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	▲ 0.072				-	▲ 0.130	0.100	▲ 0.005	21,680.34	▲ 123.28	113.56-57	113.29-30
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.132						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.230	▲ 0.033				-	▲ 0.136						
2W	▲ 0.047	▲ 0.040	▲ 0.043				-	▲ 0.138						
3W							-	▲ 0.141						
1M							-	▲ 0.147						
3M							▲ 0.330	▲ 0.161						
6M							▲ 0.240	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.161						
									日付	11/9	11/12	11/13	11/14	11/15
									日銀当預残	3,919,700	3,917,600	3,921,500	3,918,900	3,927,500
									準備預金残	3,437,400	3,436,700	3,421,900	3,418,600	3,438,300
									マネタリーベース	5,016,800	5,013,900	5,017,500	5,014,000	5,023,100
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.070%	▲0.072%	▲0.067%	▲0.073%
									コール市場残高	99,432	97,219	91,165	90,591	123,143
									うち無担	85,934	82,088	79,451	74,293	94,093
									うちO/N	43,044	46,298	45,891	42,283	61,953
									うち有担	13,498	15,131	11,714	16,298	29,050

## ●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	796	-	42,500	2018/11/19	2019/2/25	140,973.0	34,521.8	100.0765	▲0.2847%	74.0689%	100.0802	▲0.2984%	7,978.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/11/19	2018/12/3		1,462	1,462				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/11/19			9,391	4,512	▲0.005		▲0.005	74.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/11/19			4,902	1,810	▲0.007		▲0.005	7.6
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/11/19			1,384	504	▲0.008		▲0.007	78.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	139,488	2018/11/16	2018/11/19		635	635		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,713	2018/11/16	2018/11/19		72	72		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年11月19日の予定

*10月の貿易統計	*国庫短期証券(797回)入札 (1年物、21,000億円、11/20発行)
-----------	---

◆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