

Central Daily Market Report

2018年11月19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19日		2018年11月20日		2018年11月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 1,000		▲ 1,000	
財政	▲ 1,500		▲ 1,300		▲ 13,000	
資金過不足	▲ 1,500		▲ 2,300		▲ 14,000	
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	1,500	▲ 1,800				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,100		8,100			
CP等買入				▲ 300		
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			500			
国債補完供給	▲ 700	700		700		
当預増減	5,300		6,700		▲ 14,000	
当座預金残高	3,914,600		3,921,300		3,907,300	
準備預金残高	3,426,700					
積み終了先	3,409,400					
超過準備	3,406,000					
非準備預金先	487,900					
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	98.79%	日数	13.33%		

●2018年11月19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～▲0.045%での調達で始まった。積みみの序盤ということもあり、調達サイドから取り急ぎ動きは見られず、一巡後は▲0.080%程度の出合いが見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物は出合い閑散であった。

<レポ市場>

GC T+0(11/19-11/20)は▲0.140～▲0.115%程度の出合い、T/N(11/20-11/21)は▲0.170～▲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)は小幅低下した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.17～▲0.168%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1687%、按分落札利回▲0.1647%と前回債からレートが低下する結果となった。セカンダリーでは、▲0.1725～▲0.17%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.33～▲0.32%で、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、小売・鉄鋼・石油等の業態で大型案件が見られ、償還総額300億円程度に対して、発行総額は2,700億円程度と大幅な発行超となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/11/19	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	▲ 0.068				-	▲ 0.131	0.090	▲ 0.010	21,821.16	140.82	112.72-74	112.74-75
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.165						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.035	▲ 0.044				-	▲ 0.152						
2W	▲ 0.040	▲ 0.038	▲ 0.039				-	▲ 0.155						
3W			▲ 0.012				-	▲ 0.155						
1M							-	▲ 0.157						
3M							▲ 0.320	▲ 0.163						
6M							▲ 0.240	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.174	▲ 0.161						
									日付	11/12	11/13	11/14	11/15	11/16
									日銀当預残	3,917,600	3,921,500	3,918,900	3,927,500	3,909,300
									準備預金残	3,436,700	3,421,900	3,418,600	3,438,300	3,422,600
									マネタリーベース	5,013,900	5,017,500	5,014,000	5,023,100	5,005,500
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.072%	▲0.067%	▲0.073%	▲0.072%
									コール市場残高	97,219	91,165	90,591	123,143	104,337
									うち無担	82,088	79,451	74,293	94,093	91,082
									うちO/N	46,298	45,891	42,283	61,953	58,222
									うち有担	15,131	11,714	16,298	29,050	13,255

●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)
国庫短期証券	797	-	21,000	2018/11/20	2019/11/20	70,544.0	17,129.7	100.1650	▲0.1647%	60.7387%	100.1690	▲0.1687%	3,870.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/11/20			1,263	500	0.024		0.025	97.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2018/11/20			10,111	3,502	▲0.003		▲0.002	7.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2018/11/20			9,086	4,007	▲0.005		▲0.005	91.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	76,073	2018/11/19	2018/11/20		651	651		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月20日の予定

*米国10月の住宅着工件数	*20年利付国債入札(10,000億円、11/21発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/30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