

Central Daily Market Report

2018年11月21日(水)

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21日		2018年11月22日		2018年11月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 2,100		0	
財政	▲ 13,800		8,300		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 15,500		6,200		▲ 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						▲ 2,200
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				▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入						
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	▲ 15,400		6,600		▲ 4,200	
当座預金残高	3,905,000		3,911,600		3,907,400	
準備預金残高	3,411,000					
積み終了先	3,403,900				11月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,403,900				積数 17,900	
非準備預金先	494,000				1日平均 700	
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	99.41%	日数	20.00%		

●2018年11月21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~▲0.040%近辺の幅広いレート帯での調達で始まった。一巡後の出会い水準は▲0.086~▲0.080%程度で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T+0(11/21-11/22)は▲0.120~▲0.115%程度のお合い。T/N(11/22-11/26)は▲0.175~▲0.135%程度のお合い。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10Y335~351、5Y135~136、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、レートが小幅低下した。アウトライト市場では、短国買入オペが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+0.027%、平均落札利回較差+0.031%と、引け値のレートが低い特定の銘柄の在庫調整売りからか、弱い結果となった。マーケットでは、6M物が▲0.24%、1Y物が▲0.17~▲0.168%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、電力業態で複数発行が見られ、償還総額400億円程度に対して、発行総額は1,120億円程度と発行超となった。発行レートは一部銘柄を除いて、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/11/21	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	▲ 0.069				-	▲ 0.137	0.091	▲ 0.009	21,507.54	▲ 75.58	112.70-71	112.86-87
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.165						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.167						
2W	▲ 0.045	▲ 0.005	▲ 0.034				-	▲ 0.169						
3W							-	▲ 0.169						
1M							-	▲ 0.168						
3M							▲ 0.319	▲ 0.175						
6M							▲ 0.240	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.172	▲ 0.163						
									日付	11/14	11/15	11/16	11/19	11/20
									日銀当預残	3,918,900	3,927,500	3,909,300	3,914,600	3,920,400
									準備預金残	3,418,600	3,438,300	3,422,600	3,426,600	3,415,000
									マネタリーベース	5,014,000	5,023,100	5,005,500	5,010,800	5,017,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.067%	▲ 0.073%	▲ 0.072%	▲ 0.068%	▲ 0.066%
									コール市場残高	90,591	123,143	104,337	95,722	91,523
									うち無担	74,293	94,093	91,082	79,996	77,927
									うちO/N	42,283	61,953	58,222	45,406	42,987
									うち有担	16,298	29,050	13,255	15,726	13,596

●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	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
国庫短期証券買入	1,000	2018/11/22			7,493	1,000	0.027		0.031	44.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	64,260	2018/11/21	2018/11/22		173	173		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年11月22日の予定

*10月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮)+1.0% *月例経済報告	*New York祝日(Thanksgiving Day)	*国庫短期証券(798回)入札 (3ヶ月、42,800億円、11/26発行) *流動性供給入札 (6,000億円、11/26発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、12/4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