

Central Daily Market Report

2018年11月22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22日		2018年11月26日		2018年11月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,000		▲ 200		0	
財政	8,800		▲ 8,800		▲ 1,000	
資金過不足	6,800		▲ 9,000		▲ 1,000	
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			2,600	▲ 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		▲ 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		▲ 200		▲ 100	800	
E T F買入			1,200			
国債補完供給		200				
当預増減	7,200		▲ 7,600		▲ 200	
当座預金残高	3,912,200		3,904,600		3,904,400	
準備預金残高	3,402,300					
積み終了先	3,401,000				11月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,399,700				積数	
非準備預金先	509,900				1日平均	
					400	
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額					3,011,000	
準備預金進捗率	実績		99.76%		日数	
					33.33%	

●2018年11月22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~▲0.035%近辺の調達で始まった。連休要因があったものの特段取り急ぐ動きは見られず、一巡後は▲0.086~▲0.060%の出合い水準で推移した。ターム物は、出合い閑散であった。

<レポ市場>

GC T+0(11/22-11/26)は▲0.120~▲0.115%程度の出合い。T/N(11/26-11/27)は▲0.170~▲0.125%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10Y335~351、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)は小幅上昇。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▲0.265~▲0.253%での出合いと弱含みの展開となる中、平均落札利回▲0.2687%、按分落札利回▲0.2530%と落ち着いた結果となった。セカンダリーでは、▲0.285~▲0.275%での出合いと強含みで推移した。この他に、6M物が▲0.24%、1Y物が▲0.17%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、小売業態で比較的多く発行が見られたものの、案件少なく、閑散とした市況だった。償還総額50億円弱程度に対して、発行総額は300億円程度となった。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

2018/11/22	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	▲ 0.071				-	▲ 0.134	0.090	▲ 0.001	21,646.55	139.01	113.02-04	113.01-02
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.167						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.035	▲ 0.037				-	▲ 0.177						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.174						
3W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.023				-	▲ 0.172						
1M							-	▲ 0.173						
3M							▲ 0.290	▲ 0.177						
6M							▲ 0.235	▲ 0.163						
1Y							▲ 0.169	▲ 0.164						
									日付	11/15	11/16	11/19	11/20	11/21
									日銀当預残	3,927,500	3,909,300	3,914,600	3,920,400	3,905,000
									準備預金残	3,438,300	3,422,600	3,426,600	3,415,000	3,411,200
									マネタリーベース	5,023,100	5,005,500	5,010,800	5,017,600	5,003,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.073%	▲ 0.072%	▲ 0.068%	▲ 0.066%	▲ 0.069%
									コール市場残高	123,143	104,337	95,722	91,523	98,697
									うち無担	94,093	91,082	79,996	77,927	84,506
									うちO/N	61,953	58,222	45,406	42,987	49,596
									うち有担	29,050	13,255	15,726	13,596	14,191

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	798	-	42,800	2018/11/26	2019/3/4	125,490.0	34,907.7	100.0680	▲0.2530%	10.2298%	100.0722	▲0.2687%	7,892.0
流動性供給	274	-	6,000	2018/11/26		15,478.0	5,979.0		0.0030%	73.9742%		0.0010%	
交付税特会	-	-	10,500	2018/12/4	2019/6/4	230,227.0	10,500.04		0.0000%	4.5608%		0.0000%	

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2018/11/26	2018/12/10		2,641	2,641				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	93,835	2018/11/22	2018/11/26		11	11		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月26日の予定

*9月の景気動向指数改訂状況

◆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