

Central Daily Market Report

2018年11月27日(火)

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27日		2018年11月28日		2018年11月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 400		▲ 1,000	
財政	1,500		▲ 6,800		▲ 1,000	
資金過不足	1,200		▲ 7,200		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	7,200					
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	800			▲ 100		
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	9,400		▲ 6,400		▲ 2,000	
当座預金残高	3,911,400		3,905,000		3,903,000	
準備預金残高	3,418,700					
積み終了先	3,417,200		11月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,417,200		積数		4,300	
非準備預金先	492,700		1日平均		200	
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		99.86%		日数	
					40.00%	

●2018年11月27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~▲0.055%近辺の調達で始まった。引き続き調達ニーズが弱い状況に変化はなく、一巡後は▲0.08%近辺の出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件中心で散発的に出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(11/27-11/28)は▲0.12~▲0.10%程度、T/N(11/28-11/29)は▲0.17~▲0.12%程度で出合いが見られた。引き続き運用サイドがしっかりしており、レート低位での取引だった。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10Y341~352や、5Y126、127、131などにビッドが目立った他、入札のあった40Y11は、レートは緩んだが、若干のビッドニーズも見られた。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、低水準で推移した。アウトライト市場では、短国買入オベが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+0.020%、平均落札利回較差+0.045%と在庫調整の売りから弱い結果となった。その後のマーケットでも、3M物が▲0.29%、1Y物が▲0.168~▲0.162%出合いと全般的に弱含みで推移した。

<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、鉄鋼・海運・不動産・電力等の複数業態で大型案件が見られ、償還総額2,100億円程度に対して、発行総額は4,500億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。本日はCP等買入オベが2,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート0.002%・按分レート▲0.002%と、前回(平均0.001%・按分▲0.004%)比で平均、按分ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2018/11/27	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	▲ 0.073				-	▲ 0.126	0.085	0.000	21,952.40	140.40	113.50-51	113.59-60
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.165						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.028				-	▲ 0.179						
2W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.176						
3W							-	▲ 0.174						
1M							-	▲ 0.175						
3M							▲ 0.289	▲ 0.175						
6M							▲ 0.228	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.163						
									日付	11/19	11/20	11/21	11/22	11/26
									日銀当預残	3,914,600	3,920,400	3,905,000	3,912,200	3,902,000
									準備預金残	3,426,600	3,415,000	3,411,200	3,402,300	3,406,600
									マネタリーベース	5,010,800	5,017,600	5,003,900	5,013,100	5,003,100
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.066%	▲0.069%	▲0.071%	▲0.070%
									コール市場残高	95,722	91,523	98,697	103,199	101,525
									うち無担	79,996	77,927	84,506	89,992	80,786
									うちO/N	45,406	42,987	49,596	55,902	47,796
									うち有担	15,726	13,596	14,191	13,207	20,739

●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)
40年利付国債	11	0.80%	4,000	2018/11/28	2058/3/20	15,387.0	3,993.00		0.9400%	57.2420%			

●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	2018/11/28			6,968	1,000	0.020		0.045	5.6
CP等買入	2,000	2018/11/30			5,582	1,970	▲0.002		0.002	85.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,515	2018/11/27	2018/11/28		124	124		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/11/29	2018/12/6	2.7	0	0				

●2018年11月28日の予定

- *米国7-9月期のGDP改定値
- *米国10月の新築一戸建て販売件数

◆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