

Central Daily Market Report

2018年11月29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29日		2018年11月30日		2018年12月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 600		▲ 1,000	
財政	▲ 2,700		5,100		▲ 38,000	
資金過不足	▲ 4,300		4,500		▲ 39,000	
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,900					
CP等買入		▲ 100	2,000	▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						▲ 11,500
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入	300		400			
国債補完供給	▲ 1,100		1,100			
当預増減	2,700		6,900		▲ 52,000	
当座預金残高	3,909,700		3,916,600		3,864,600	
準備預金残高	3,421,300					
積み終了先	3,421,000					
超過準備	3,420,800					
非準備預金先	488,400					
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	99.89%	日数	46.67%		

●2018年11月29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~▲0.05%近辺の調達で始まった。昨日同様に低調な地合いとなり、一巡後は▲0.08%台で散発的な出合いが見られた程度であった。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(11/29-11/30)は▲0.12%程度、T/N(11/30-12/3)は▲0.15~▲0.10%程度で出合いが見られた。月末初と週末が重なっており、レートの下も警戒されたが、調達サイドがしっかりしており、前日から横ばい圏での取引だった。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。

<短国市場>

現先レート(T/N)は横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散で特段の出合いは見られなかった。

<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、卸売・鉄鋼・建設・機械の複数業態で大型案件が見られ、償還総額1,600億円程度に対して、発行総額は4,100億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

2018/11/29	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.122	0.080	▲ 0.015	22,262.60	85.58	113.56-57	113.24-25
T/N	▲ 0.015	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.166						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.034				-	▲ 0.159						
2W	▲ 0.035	▲ 0.033	▲ 0.034				-	▲ 0.159						
3W							-	▲ 0.162						
1M							-	▲ 0.165						
3M							▲ 0.285	▲ 0.165						
6M							▲ 0.225	▲ 0.162						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.161						
									日付	11/21	11/22	11/26	11/27	11/28
									日銀当預残	3,905,000	3,912,200	3,902,000	3,911,400	3,907,000
									準備預金残	3,411,200	3,402,300	3,406,600	3,418,700	3,414,800
									マネタリーベース	5,003,900	5,013,100	5,003,100	5,012,800	5,008,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.069%	▲ 0.071%	▲ 0.070%	▲ 0.073%	▲ 0.070%
									コール市場残高	98,697	103,199	101,525	99,816	96,884
									うち無担	84,506	89,992	80,786	84,394	78,868
									うちO/N	49,596	55,902	47,796	52,404	47,078
									うち有担	14,191	13,207	20,739	15,422	18,016

●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)
2年利付国債	395	0.10%	21,000	2018/12/3	2020/12/1	81,456.0	17,471.00	100.4650	▲0.1320%	29.1766%	100.4680	▲0.1340%	3,524.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	157,935	2018/11/29	2018/11/30		996	996		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	15,091	2018/11/29	2018/11/30		62	62		▲0.600	▲0.600	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数					
成長基盤強化	本則第34回	2018/12/3	2022/12/2	0	4,099	39				
成長基盤強化	ABL等特則第30期	2018/12/4	2022/12/2	0	3	2				
成長基盤強化	小口特則第27期	2018/12/3	2022/12/2	0	5.98	12				
成長基盤強化	米ドル特則第26期	2018/12/4	2019/12/4		832	20				
成長基盤強化	米ドル特則第22期(借り換え)	2018/12/4	2019/12/4		569	18				
成長基盤強化	米ドル特則第18期(借り換え)	2018/12/4	2019/12/4		3,721	30				
成長基盤強化	米ドル特則第14期(借り換え)	2018/12/4	2019/12/4		13	11				

●2018年11月30日の予定

*11月の都区部消費者物価指数(CPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮)+1.0%	*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 市場予想:前月比+1.2%	*米国11月のシカゴPM景況感指数
*10月の完全失業率(市場予想:2.3%)	*10月の消費動向調査	*ユーロ圏11月の消費者物価指数速報値
*10月の有効求人倍率(市場予想:1.65倍)	*10月の住宅着工統計	*国庫短期証券(799回)入札 (3ヶ月、42,500億円、12/3発行)

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されていますが、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