

# Central Daily Market Report

2018年11月30日(金)

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30日		2018年12月3日		2018年12月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 400		▲ 1,000	
財政	3,900		▲ 41,700		▲ 72,000	
資金過不足	3,400		▲ 42,100		▲ 73,000	
<b>金融調節</b>	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			1,900	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,200			
CP等買入	2,000	▲ 1,100		▲ 100		
貸出支援基金(成)			4,100	▲ 6,900		▲ 200
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	400					
国債補完供給	▲ 2,600	1,100		2,600		
当預増減	3,200		▲ 34,800		▲ 73,200	
当座預金残高	3,912,900		3,878,100		3,804,900	
準備預金残高	3,425,100					
積み終了先	3,424,700				12月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,424,700				積数 2,300	
非準備預金先	487,800				1日平均 200	
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額					3,008,500	
準備預金進捗率	実績		99.92%		日数 56.67%	

## ●2018年11月30日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.086~▲0.035%近辺の調達で始まった。月末要因によりビッド件数が少なくオファーが出し残る軟調な展開となった。一巡後は▲0.08%近辺の出合いが散見され、今月の取引を終えた。ターム物は、ショートタームを中心に出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(11/30-12/3)は▲0.20~▲0.09%程度、T/N(12/3-12/4)は▲0.105~▲0.085%程度で出合いが見られた。12/3は短国と2年債の発行が重なっており、調達サイドが厚かった。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)は上昇した。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▲0.20~▲0.19%の出合いが見られる中、平均落札利回り▲0.1991%、按分落札利回り▲0.1712%と前回債からレートは上昇し、按分レートが流れる結果となった。セカンダリーでは、▲0.175%出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、1Y物が▲0.15%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、ノンバンク・石油・化学業態で大型案件が見られ、償還総額900億円程度に対して、発行総額は1,600億円程度と発行超となった。発行レートは、一部銘柄に強い買いもみられたが、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/11/30	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	▲ 0.062				-	▲ 0.102	0.085	0.005	22,351.06	88.46	113.41-42	113.46-48
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.114						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.013				-	▲ 0.119						
2W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.036				-	▲ 0.122						
3W							-	▲ 0.134						
1M							-	▲ 0.169						
3M							▲ 0.180	▲ 0.161						
6M							▲ 0.215	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.160						
									日付	11/22	11/26	11/27	11/28	11/29
									日銀当預残	3,912,200	3,902,000	3,911,400	3,907,000	3,909,700
									準備預金残	3,402,300	3,406,600	3,418,700	3,414,800	3,418,300
									マネタリーベース	5,013,100	5,003,100	5,012,800	5,008,700	5,013,000
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.070%	▲0.073%	▲0.070%	▲0.072%
									コール市場残高	103,199	101,525	99,816	96,884	101,360
									うち無担	89,992	80,786	84,394	78,868	81,763
									うちO/N	55,902	47,796	52,404	47,078	49,033
									うち有担	13,207	20,739	15,422	18,016	19,597

## ●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	799	-	42,500	2018/12/3	2019/3/11	121,311.0	34,416.8	100.0460	▲0.1712%	36.5818%	100.0535	▲0.1991%	8,083.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/12/3	2018/12/17		1,855	1,855				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/12/3			8,051	4,512	0.000		0.001	52.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/12/3			5,179	1,815	0.001		0.002	66.1
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/12/3			1,838	506	▲0.003		▲0.002	14.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	169,040	2018/11/30	2018/12/3		987	987		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	239,053	2018/11/30	2018/12/3		1,393	1,393		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年12月3日の予定

\*7-9月期の法人企業統計調査季報

\*米国10月の建設支出

\*米国11月のISM製造業景況指数

◆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