Central Daily Market Report

2018年11月7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7日 需給速報		2018年11月8日 需給予想		2018年11月9日 当社予想	
銀行券	700		▲ 200		0	
財政	▲ 3,800		▲ 200		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 3,100		▲ 400		▲ 7,000	
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						
CP等買入				▲ 100	2,000	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入			100			
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 2,000		▲ 400		▲ 5,000	

当座預金残高	3,920,900	3,920,500	3,915,500
準備預金残高	3,436,100		
積み終了先	3,435,500		
超過準備	3,435,500		
非準備預金先	484,800		

11月8日以降の残り所要積立額	
積数	1,400
1日平均	200

積み期間（10/16～11/15）の所要準備額			3,105,100
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	74.19%

●2018年11月7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～▲0.050%の出合いとほぼ横ばい圏で推移した。引き続き取り手が少なく、一巡後は閑散とした地合いの中、調整で▲0.050%の出合いが見られた程度であった。ターム物に関してはショートタームで▲0.045～▲0.040%の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(11/7-11/8)は▲0.130～▲0.100%程度の出合い。T/N(11/8-11/9)は▲0.140～▲0.110%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10Y335～352、5Y135～137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はレートが小幅上昇した。アウトライト市場は、週内の2回の入札を控え、様子見姿勢が強く閑散な中、3M物が▲0.29～▲0.28%、1Y物が▲0.165%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は案件少なく、発行総額300億円程度と閑散であった（償還総額3,000億円程度）。発行レートは引き続き0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/11/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.070				－	▲ 0.122
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.149
S/N							－	－
1W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.037				－	▲ 0.145
2W	▲ 0.045	▲ 0.042	▲ 0.043				－	▲ 0.146
3W							－	▲ 0.146
1M			0.005				－	▲ 0.149
3M							▲ 0.285	▲ 0.153
6M							▲ 0.226	▲ 0.152
1Y							▲ 0.165	▲ 0.159

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.120	▲ 0.005	22,085.80	▲ 61.95	113.34-35	113.06-07

日付	10/31	11/1	11/2	11/5	11/6
日銀当預残	3,970,300	3,940,300	3,908,100	3,917,700	3,922,900
準備預金残	3,464,500	3,449,200	3,426,300	3,432,800	3,439,100
マネタリーベース	5,068,800	5,039,700	5,007,900	5,016,700	5,021,100
無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.072%	▲0.071%
コール市場残高	78,500	100,619	109,205	93,410	89,153
うち無担	66,848	86,584	91,293	76,599	74,887
うちO/N	34,528	54,064	56,623	42,029	42,547
うち有担	11,652	14,035	17,912	16,811	14,266

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
交付税特会	－	－	10,500	2018/11/15	2019/5/16	233,802.0	10,500.10		0.0000%	4.4911%		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	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）	11,713	2018/11/7	2018/11/8		24	24		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月8日の予定

*決定会合における主な意見（10月30、31日分）
*9月の国際収支
*9月の機械受注統計
（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲10.0%）
*10月の景気ウォッチャー調査
*米国FOMC（2日目）
*国庫短期証券（794回）入札
（6ヶ月、23,000億円、11/12発行）
*流動性供給入札
（4,000億円、11/9発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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