

Central Daily Market Report

2018年11月20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20日		2018年11月21日		2018年11月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,600		▲ 2,000	
財政	▲ 1,900		▲ 12,600		2,000	
資金過不足	▲ 2,900		▲ 14,200		0	
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						
国債買入	8,100					
CP等買入		▲ 300				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入	500					
国債補完供給	▲ 300	700		300		
当預増減	5,800		▲ 13,900		0	
当座預金残高	3,920,400		3,906,500		3,906,500	
準備預金残高	3,414,800					
積み終了先	3,407,400				11月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,403,500				積数 25.100	
非準備預金先	505,600				1日平均 1.000	
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額					3,010,900	
準備預金進捗率	実績		99.17%		日数 16.67%	

●2018年11月20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～▲0.050%近辺の調達で始まった。一巡後は調達サイドの目途が付き、▲0.08%で調整の出合いが散見された。ターム物に関してはショートタームで▲0.035%程度の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(11/20-11/21)は▲0.150～▲0.115%程度の出合い。T/N(11/21-11/22)は▲0.165～▲0.135%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)は低水準で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.319%で、1Y物が▲0.173%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、償還総額800億円程度に対して、発行総額は900億円程度と若干の発行超となった。発行レートは、一部銘柄で強い買いが見られたものの、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/11/20	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	0.030	▲ 0.066				-	▲ 0.137	0.100	0.010	21,583.12	▲ 238.04	112.45-46	112.51-52
T/N	▲ 0.015	0.030	0.000				-	▲ 0.166						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.043				-	▲ 0.163						
2W	▲ 0.035	▲ 0.008	▲ 0.026				-	▲ 0.164						
3W							-	▲ 0.163						
1M			▲ 0.022				-	▲ 0.162						
3M							▲ 0.319	▲ 0.166						
6M							▲ 0.240	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.173	▲ 0.162						
									日付	11/13	11/14	11/15	11/16	11/19
									日銀当預残	3,921,500	3,918,900	3,927,500	3,909,300	3,914,600
									準備預金残	3,421,900	3,418,600	3,438,300	3,422,600	3,426,600
									マネタリーベース	5,017,500	5,014,000	5,023,100	5,005,500	5,010,800
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.067%	▲0.073%	▲0.072%	▲0.068%
									コール市場残高	91,165	90,591	123,143	104,337	95,722
									うち無担	79,451	74,293	94,093	91,082	79,996
									うちO/N	45,891	42,283	61,953	58,222	45,406
									うち有担	11,714	16,298	29,050	13,255	15,726

●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)
20年利付国債	166	0.70%	10,000	2018/11/21	2038/9/20	31,493.0	8,060.00	101.5000	0.6150%	45.3947%	101.5500	0.6120%	1,932.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/11/30	2019/5/31	246,143.0	10,500.05		0.0000%	4.2867%		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
社債等買入	750	2018/11/27			1,927	750	▲0.023		▲0.015	63.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,165	2018/11/20	2018/11/21		272	272		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,931	2018/11/20	2018/11/21		8	8		▲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)
被災地金融支援オペ	第91回	2018/11/22	2019/11/22	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第30回	2018/11/22	2019/11/22	0

●2018年11月21日の予定

*米国10月の中古住宅販売

*米国10月の耐久財新規受注

◆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