

Central Daily Market Report

2018年11月26日(月)

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26日		2018年11月27日		2018年11月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 400		▲ 1,000	
財政	▲ 11,200		1,200		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 11,400		800		▲ 3,000	
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	2,600	▲ 2,200				
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		▲ 100		▲ 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		▲ 100	800			
E T F 買入	1,200		300			
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	▲ 10,200		9,100		▲ 3,000	
当座預金残高	3,902,000		3,911,100		3,908,100	
準備預金残高	3,404,900					
積み終了先	3,403,500				11月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,403,500				積数 5,900	
非準備預金先	497,100				1日平均 300	
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		99.80%		日数 36.67%	

●2018年11月26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。先週末と同様に調達意欲は弱く、一巡後も調達側の参加者はほとんど現れず、▲0.086~▲0.080%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(11/26-11/27)は▲0.16~▲0.10%程度、T/N(11/27-11/28)は▲0.17~▲0.12%程度で出合いが見られた。前週に続いて運用サイドがしっかりしており、レートは低位横ばいだった。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、入札を控えた40Y11にまとまったビッドが見られた。

<短国市場>

現先レート(T/N)は低水準で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.17%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・食料品・ガス・石油の複数業態で大型案件が見られ、償還総額480億円程度に対して、発行総額は3,000億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

2018/11/26	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	0.001	▲ 0.070				-	▲ 0.126	0.085	▲ 0.005	21,812.00	165.45	112.92-94	113.23-24
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.162						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.048	▲ 0.015	▲ 0.039				-	▲ 0.176						
2W							-	▲ 0.175						
3W							-	▲ 0.174						
1M							-	▲ 0.173						
3M							▲ 0.290	▲ 0.176						
6M							▲ 0.235	▲ 0.163						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.163						
									日付	11/16	11/19	11/20	11/21	11/22
									日銀当預残	3,909,300	3,914,600	3,920,400	3,905,000	3,912,200
									準備預金残	3,422,600	3,426,600	3,415,000	3,411,200	3,402,300
									マネタリーベース	5,005,500	5,010,800	5,017,600	5,003,900	5,013,100
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.068%	▲0.066%	▲0.069%	▲0.071%
									コール市場残高	104,337	95,722	91,523	98,697	103,199
									うち無担	91,082	79,996	77,927	84,506	89,992
									うちO/N	58,222	45,406	42,987	49,596	55,902
									うち有担	13,255	15,726	13,596	14,191	13,207

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	応募総額(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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/11/27			10,151	4,506	▲0.003		▲0.002	67.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/11/27			6,742	1,811	▲0.001		0.001	4.9
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/11/27			1,948	503	0.003		0.003	90.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	51,680	2018/11/26	2018/11/27		234	234		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月27日の予定

*10月の企業向けサービス価格指数	*米国9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(4,000億円、11/28発行)
	*米国11月の米CB消費者信頼感指数	

◆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