

Central Daily Market Report

2018年11月28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28日		2018年11月29日		2018年11月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 1,600		▲ 1,100	
財政	▲ 4,800		400		5,100	
資金過不足	▲ 5,200		▲ 1,200		4,000	
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			7,900			
CP等買入		▲ 200	▲ 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		▲ 100				
E T F買入			300			
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 4,400		6,900		6,000	
当座預金残高	3,907,000		3,913,900		3,919,900	
準備預金残高	3,414,700					
積み終了先	3,414,200				11月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,414,200				積数	
非準備預金先	492,300				1日平均	
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		99.87%		日数	
					43.33%	

●2018年11月28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。資金調達意欲は引き続き弱く、一巡後は▲0.08%前後の出合いが見られた。ターム物は、ショートタームを中心に数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(11/28-11/29)は▲0.13~▲0.10%程度、T/N(11/29-11/30)は▲0.155~▲0.12%程度で出合いが見られた。前日に比べるとやや運用サイドが慎重だった。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、131などにビッドが目立った。

<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、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.162~▲0.16%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、月末発行日にあたり、ノンバンク・機械・鉄鋼・ゴム製品等の幅広い業態で大型案件が見られ、活況なマーケットとなった。償還総額9,600億円程度に対して、発行総額は1兆1,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは、ノンバンク1社による2,000億円越えの大型案件も0%程度で終わるなど、依然として0%付近では強い買いがみられ、全体としては概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/11/28	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				-	▲ 0.122	0.095	0.010	22,177.02	224.62	113.79-80	113.86-87
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.160						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.040				-	▲ 0.170						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.030				-	▲ 0.167						
3W							-	▲ 0.168						
1M			0.020				-	▲ 0.170						
3M							▲ 0.285	▲ 0.171						
6M							▲ 0.225	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.163						
									日付	11/20	11/21	11/22	11/26	11/27
									日銀当預残	3,920,400	3,905,000	3,912,200	3,902,000	3,911,400
									準備預金残	3,415,000	3,411,200	3,402,300	3,406,600	3,418,700
									マネタリーベース	5,017,600	5,003,900	5,013,100	5,003,100	5,012,800
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.069%	▲0.071%	▲0.070%	▲0.073%
									コール市場残高	91,523	98,697	103,199	101,525	99,816
									うち無担	77,927	84,506	89,992	80,786	84,394
									うちO/N	42,987	49,596	55,902	47,796	52,404
									うち有担	13,596	14,191	13,207	20,739	15,422

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2018/11/29			9,836	3,506	0.001		0.002	31.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2018/11/29			14,866	4,008	0.001		0.002	22.3
国債買入(物価連動債)	250	2018/11/29			1,464	252	▲0.160		▲0.203	54.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,804	2018/11/28	2018/11/29		17	17		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月29日の予定

*政井審議委員、福岡県金融経済懇談会にて講演	*米国10月の個人所得・消費支出	*2年利付国債入札(21,000億円、12/3発行)
*10月の商業動態統計速報		

◆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