

Central Daily Market Report

2019年11月5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	2019年11月5日		2019年11月6日		2019年11月7日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	600	900				0
財政	▲ 7,400	▲ 700				▲ 21,000
資金過不足	▲ 6,800	200				▲ 21,000
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	1,700	▲ 3,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	4,100		9,200			
CP等買入		▲ 100				
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						
国債補完供給	▲ 200		200			
当預増減	▲ 4,900	9,600				▲ 21,000
当座預金残高	4,071,600	4,081,200	4,060,200			
準備預金残高	3,537,700					
積み終了先	3,537,500					
超過準備	3,537,400					
非準備預金先	533,900					
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額						3,193,600
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	67.74%		

●2019年11月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落し、小幅低下となった。朝方は国内勢を中心に▲0.035~▲0.02%の出合い。一巡後は様子見姿勢から閑散であった。ターム物はショートターム物の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/6-11/7)は、▲0.100~▲0.065%程度での出合い。SCはローラー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2Y402~405、10Y336~356、5Y136~141、20Y167~170、30Y59~64、40Y9~12等にビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.170~▲0.165%、引け際に1Y物が▲0.230%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額600億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と若干の発行超であった。一部のその他金融業態から大型の発行が見られたものの、案件数が少なく閑散としたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/11/5	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.079	▲ 0.140	0.045	23,251.99	401.22	108.70-71	108.78-79
T/N			▲ 0.035				-	▲ 0.071						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.005	▲ 0.018				-	▲ 0.071						
2W							-	▲ 0.073						
3W							-	▲ 0.077						
1M							-	▲ 0.081						
3M							▲ 0.170	▲ 0.124						
6M							▲ 0.225	▲ 0.168						
1Y							▲ 0.230	▲ 0.192						
									日付	10/28	10/29	10/30	10/31	11/1
									日銀当預残	4,102,400	4,109,100	4,108,300	4,106,100	4,076,500
									準備預金残	3,588,400	3,578,700	3,572,500	3,563,800	3,534,500
									マネタリーベース	5,224,700	5,231,700	5,231,300	5,230,300	5,201,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.021%	▲ 0.024%	▲ 0.030%	▲ 0.024%
									コール市場残高	94,647	96,753	97,659	94,239	103,771
									うち無担	75,521	77,200	77,828	74,425	83,920
									うちO/N	50,486	51,675	53,053	53,760	60,905
									うち有担	19,126	19,553	19,831	19,814	19,851

●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)	4,200	2019/11/6			9,471	4,209	0.020		0.021	24.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/11/6			9,329	3,406	0.023		0.025	24.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2019/11/6			4,153	1,005	0.033		0.033	49.8
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/11/6			1,002	304	0.026		0.026	56.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/5	2019/11/6	▲ 0.350	206	206		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/11/7	2019/11/15	2.080		1				

●2019年11月6日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(9月18、19日分)	*10年利付国債入札(21,000億円、11/7発行)
*11月の日銀当座預金増減要因見込み	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/15借入)

◆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