

Central Daily Market Report

2019年11月8日(金)

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8日		2019年11月11日		2019年11月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		1,100		1,000	
財政	2,000		▲ 14,400		1,000	
資金過不足	2,500		▲ 13,300		2,000	
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			4,500	▲ 5,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 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	2,000		▲ 14,300		2,000	
当座預金残高	4,061,800		4,047,500		4,049,500	
準備預金残高	3,519,000					
積み終了先	3,518,800					
超過準備	3,518,800					
非準備預金先	542,800					
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,197,900	
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	83.87%		

●2019年11月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、調達サイドの慎重姿勢により、レート低下となった。朝方は国内勢を中心に▲0.08%台から▲0.04%程度の出合い。一巡後も調達サイドの参加者は限定的で、同水準の出合いが散見された程度で本日の取引を終えた。ターム物も慎重姿勢から閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(11/11-11/12)は、▲0.150~▲0.100%程度での出合い。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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.150~▲0.145%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1492%、按分落札利回▲0.1451%と、WI取引を反映して落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、少額ながら▲0.210~▲0.200%と強めの出合いも見られたものの、閑散だった。この他に、1Y物が▲0.205%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350億円程度に対して、発行は無かった。

●短期金融市場関連指標

2019/11/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.104	▲ 0.065	0.025	23,391.87	61.55	109.27-28	109.28-29
T/N			▲ 0.035				-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.026				-	▲ 0.105						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.210	▲ 0.123						
6M							▲ 0.190	▲ 0.167						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.190						
									日付	10/31	11/1	11/5	11/6	11/7
									日銀当預残	4,106,100	4,076,500	4,071,600	4,080,400	4,059,800
									準備預金残	3,563,800	3,534,500	3,538,900	3,536,100	3,515,100
									マネタリーベース	5,230,300	5,201,500	5,196,000	5,203,800	5,183,200
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.024%	▲0.027%	▲0.031%	▲0.038%
									コール市場残高	94,239	103,771	97,448	97,930	106,220
									うち無担	74,425	83,920	77,597	79,599	87,464
									うちO/N	53,760	60,905	53,577	56,604	63,944
									うち有担	19,814	19,851	19,851	18,331	18,756

●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)
国庫短期証券	869	-	42,700	2019/11/11	2020/2/17	165,449.2	34,855.8	100.0390	▲0.1451%	94.2695%	100.0401	▲0.1492%	7,844.0
物価連動10年	24	0.10%	4,000	2019/11/11	2029/3/10	13,687.0	3,996.0	102.9000	▲0.2040%	83.6431%			
エネルギー対策	-	-	6,500	2019/11/20	2020/11/20	114,090.0	6,499.96		0.0000%	5.6973%		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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2019/11/11	2019/11/25		4,526	4,526				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/8	2019/11/11	▲ 0.350	131	131		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/11/8	2019/11/11	▲ 0.350	100	100		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年11月11日の予定

*決定会合における主な意見(10月30、31日分)	*New York祝日(Veterans Day)
*9月の国際収支	*英国7-9月期のGDP速報値
*9月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+0.9%)	
*9月の特定サービス産業動態統計速報	
*10月の景気ウォッチャー調査	

◆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