

Central Daily Market Report

2019年11月11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	2019年11月11日		2019年11月12日		2019年11月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100		600		0	
財政	▲15,300		▲2,800		▲8,000	
資金過不足	▲14,200		▲2,200		▲8,000	
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			11,800			
CP等買入		▲100		▲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	▲100	200		100		
当預増減	▲15,300		9,600		▲8,000	
当座預金残高	4,046,500		4,056,100		4,048,100	
準備預金残高	3,496,400					
積み終了先	3,496,100					
超過準備	3,496,100					
非準備預金先	550,100					
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	87.10%		

●2019年11月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、調達サイドの参加者が少なく、レートは先週末より大幅に低下した。朝方は国内勢を中心に、▲0.087~▲0.05%の出合いとなった。一巡後も調達サイドの慎重姿勢から、▲0.08%近辺の出合いが見られた程度であった。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(11/12-11/13)は、▲0.205~▲0.150%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2Y402~406、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、引け際に3M物が▲0.215~▲0.210%、6M物が▲0.195%、1Y物が▲0.215%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。CP発行市場は、発行・償還ともに600億円程度の規模となっており、石油業態からは大型発行が見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/11/11	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	▲0.065				-	▲0.164	▲0.070	▲0.005	23,331.84	▲60.03	109.19-20	108.95-97
T/N							-	▲0.191						
S/N							-	-						
1W			▲0.040				-	▲0.168						
2W			▲0.030				-	▲0.143						
3W							-	▲0.133						
1M							-	▲0.125						
3M							▲0.215	▲0.135						
6M							▲0.195	▲0.168						
1Y							▲0.215	▲0.189						
									日付	11/1	11/5	11/6	11/7	11/8
									日銀当預残	4,076,500	4,071,600	4,080,400	4,059,800	4,061,800
									準備預金残	3,534,500	3,538,900	3,536,100	3,515,100	3,519,700
									マネタリーベース	5,201,500	5,196,000	5,203,800	5,183,200	5,184,700
									無担O/N加重平均	▲0.024%	▲0.027%	▲0.031%	▲0.038%	▲0.050%
									コール市場残高	103,771	97,448	97,930	106,220	105,877
									うち無担	83,920	77,597	79,599	87,464	87,485
									うちO/N	60,905	53,577	56,604	63,944	54,545
									うち有担	19,851	19,851	18,331	18,756	18,392

●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年以下)	500	2019/11/12			1,820	501	▲0.004		0.003	56.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/11/12			6,190	4,201	▲0.019		▲0.012	97.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/11/12			7,047	3,405	▲0.012		▲0.010	2.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/11/12			9,105	3,506	▲0.010		▲0.009	27.5
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2019/11/11	2019/11/12	▲0.450	54	54		▲0.450	▲0.450	

●2019年11月12日の予定

*10月のマネーストック	*30年利付国債入札(7,000億円、11/13発行)
--------------	-----------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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