

# Central Daily Market Report

2019年11月12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12日		2019年11月13日		2019年11月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		700		0	
財政	▲ 1,000		▲ 6,500		0	
資金過不足	▲ 300		▲ 5,800		0	
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	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				
当預増減	11,500		▲ 4,900		0	
当座預金残高	4,058,000		4,053,100		4,053,100	
準備預金残高	3,496,900					
積み終了先	3,496,600				11月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,496,600				積数	
非準備預金先	561,100				1日平均	
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	99.99%	日数	90.32%		

## ●2019年11月12日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き調達ニーズは限定的で、レートは低下基調で推移した。朝方は国内勢を中心に▲0.087~▲0.06%の出合い。一巡後はビッドが少なく閑散であった。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(11/13-11/14)は、▲0.285~▲0.155%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。アウトライト市場では、短国買入オペアが1,000億円(前回と同額)でオファーされた。平均落札利回較差+0.013%、按分落札利回較差+0.012%と在庫調整の売りから弱めの結果となったものの、売り急ぐ動きは見られなかった。マーケットでは、6M物が▲0.200%、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500億円強となっており、小口の案件が中心であった。発行レートは引き続き0%近辺での決着が中心となった。

## ●短期金融市場関連指標

2019/11/12	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	▲ 0.070				-	▲ 0.211	▲ 0.040	0.030	23,520.01	188.17	109.04-06	109.23-24
T/N							-	▲ 0.262						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.060				-	▲ 0.217						
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.033				-	▲ 0.158						
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.140						
1M			0.010				-	▲ 0.134						
3M							▲ 0.215	▲ 0.141						
6M							▲ 0.195	▲ 0.170						
1Y							▲ 0.215	▲ 0.189						
									日付	11/5	11/6	11/7	11/8	11/11
									日銀当預残	4,071,600	4,080,400	4,059,800	4,061,800	4,046,500
									準備預金残	3,538,900	3,536,100	3,515,100	3,519,700	3,496,500
									マネタリーベース	5,196,000	5,203,800	5,183,200	5,184,700	5,168,200
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.031%	▲0.038%	▲0.050%	▲0.065%
									コール市場残高	97,448	97,930	106,220	105,877	91,318
									うち無担	77,597	79,599	87,464	87,485	76,293
									うちO/N	53,577	56,604	63,944	54,545	42,103
									うち有担	19,851	18,331	18,756	18,392	15,025

## ●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)
30年利付国債	64	0.40%	7,000	2019/11/13	2049/9/20	20,831.0	5,689.00	98.3000	0.4640%	6.0070%	98.4600	0.4580%	1,306.0

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2019/11/13			6,820	1,001	0.012		0.013	97.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/12	2019/11/13	▲ 0.450	22	22		▲ 0.450	▲ 0.450	

## ●2019年11月13日の予定

*10月の企業物価指数	*米国10月の財政収支	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/22借入)
	*米国10月の消費者物価指数	
	*英国10月の消費者物価指数	

◆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