

Central Daily Market Report

2019年11月13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	2019年11月13日		2019年11月14日		2019年11月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		▲ 500		▲ 1,000	
財政	▲ 9,700		1,200		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 9,000		700		▲ 7,000	
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	100			▲ 100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入						
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	▲ 200			200		
当預増減	▲ 8,200		700		▲ 7,000	
当座預金残高	4,049,800		4,050,500		4,043,500	
準備預金残高	3,499,300					
積み終了先	3,499,100				11月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,499,100				積数	
非準備預金先	550,500				1日平均	
					0	
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		100.00%		日数	
					93.55%	

●2019年11月13日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き調達水準を切り下げる動きが見られ、朝方は国内勢の調達を中心に▲0.087~▲0.07%の出合い。一巡後は様子見閑散で、目立った出合いは見られなかった。ターム物は1~2W物の出合いが見られた。本日は3市場合同BCP訓練の一環として、固定金利方式による共通担保資金供給オペ(O/N)物が1,000億円オファーされ、50億円の落札となった。

<レポ市場>

GC T/N(11/14-11/15)は、▲0.135~▲0.09%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、上昇した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.215%、6M物が▲0.205%、1Y物が▲0.2125%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、二営業日後が五・十日発行にあたり、総じて活況なマーケットとなった。電機・食品品業態等からは大型発行も実施され、4,400億円弱の償還総額に対し、5,400億円弱の発行が見られた。発行レートについては、概ね横ばい圏での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2019/11/13	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	▲ 0.072				-	▲ 0.108	▲ 0.050	▲ 0.010	23,319.87	▲ 200.14	108.99-00	109.06-07
T/N							-	▲ 0.132						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.030	▲ 0.043				-	▲ 0.121						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.117						
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.117						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.215	▲ 0.134						
6M							▲ 0.205	▲ 0.169						
1Y							▲ 0.213	▲ 0.187						
									日付	11/6	11/7	11/8	11/11	11/12
									日銀当預残	4,080,400	4,059,800	4,061,800	4,046,500	4,058,000
									準備預金残	3,536,100	3,515,100	3,519,700	3,496,500	3,497,300
									マネタリーベース	5,203,800	5,183,200	5,184,700	5,168,200	5,179,200
									無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.038%	▲0.050%	▲0.065%	▲0.070%
									コール市場残高	97,930	106,220	105,877	91,318	84,972
									うち無担	79,599	87,464	87,485	76,293	70,128
									うちO/N	56,604	63,944	54,545	42,103	44,358
									うち有担	18,331	18,756	18,392	15,025	14,844

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/11/22	2020/5/22	276,075.0	10,500.01		0.0000%	3.8034%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/13	2019/11/14	-0.35	170	170		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/11/13	2019/11/14	▲0.350	8	8		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/11/15	2019/11/21	2.080	1	1				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉・即日	1,000	2019/11/13	2019/11/14		50	50				

●2019年11月14日の予定

*7-9月期のGDP1次速報 (市場予想：前期比年率+0.8%)	*米国10月の生産者物価指数	*5年利付国債入札 (19,000億円、11/15発行)
*9月の第3次産業活動指数	*ユーロ圏7-9月期のGDP2次速報	

◆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