

# Central Daily Market Report

2019年11月14日(木)

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14日		2019年11月15日		2019年11月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		100		1,000	
財政	400		▲ 6,600		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 200		▲ 6,500		▲ 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		▲ 100				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 900		
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				
当預増減	▲ 200		▲ 7,400		▲ 2,000	
当座預金残高	4,049,600		4,042,200		4,040,200	
準備預金残高	3,534,200					
積み終了先	3,534,200					
超過準備	3,534,100					
非準備預金先	515,400					
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	96.77%		

## ●2019年11月14日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、積み最終日を翌日に控え、取り調整の動きも見られ、朝方は国内勢を中心に▲0.087~▲0.065%の出会いとなった。一巡後も同水準の出会いが散見された。ターム物はショートターム物の出会いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(11/15-11/18)は、▲0.12~▲0.075%程度での出会い。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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.230%、6M物が▲0.215%、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、償還総額は700億円強であったが、小売業態等から大型発行も見られたため、1,700億円強に膨らんだ。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

2019/11/14	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.074				-	▲ 0.086	▲ 0.075	▲ 0.025	23,141.55	▲ 178.32	108.79-80	108.74-75
T/N			▲ 0.060				-	▲ 0.113						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.107						
2W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.034				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.111						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.215	▲ 0.131						
6M							▲ 0.217	▲ 0.170						
1Y							▲ 0.217	▲ 0.188						
									日付	11/7	11/8	11/11	11/12	11/13
									日銀当預残	4,059,800	4,061,800	4,046,500	4,058,000	4,049,800
									準備預金残	3,515,100	3,519,700	3,496,500	3,497,300	3,499,300
									マネタリーベース	5,183,200	5,184,700	5,168,200	5,179,200	5,170,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.050%	▲ 0.065%	▲ 0.070%	▲ 0.072%
									コール市場残高	106,220	105,877	91,318	84,972	94,987
									うち無担	87,464	87,485	76,293	70,128	78,985
									うちO/N	63,944	54,545	42,103	44,358	52,965
									うち有担	18,756	18,392	15,025	14,844	16,002

## ●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)
5年利付国債	141	0.10%	19,000	2019/11/15	2024/9/20	62,733.0	15,565.0	101.4100	▲0.1880%	76.6232%	101.4200	▲0.1900%	3,430.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/14	2019/11/15	▲ 0.350	19	19		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年11月15日の予定

*9月の石油等消費動態統計	*米国9月の企業在庫	*国庫短期証券(870回)入札(3ヶ月、43,200億円、11/18発行)
	*米国10月の小売売上高	*国有林野借入(818億円、11/25借入)
	*米国10月の鉱工業生産・設備稼働率	
	*ユーロ圏10月の消費者物価指数改定値	

◆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