

# Central Daily Market Report

2019年11月18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18日		2019年11月19日		2019年11月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		200		▲ 1,000	
財政	▲ 500		▲ 3,100		3,000	
資金過不足	100		▲ 2,900		2,000	
<b>金融調節</b>	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						
国債買入	1,500					
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	▲ 300	400		300		
当預増減	1,600		▲ 2,700		2,000	
当座預金残高	4,042,600		4,039,900		4,041,900	
準備預金残高	3,525,400					
積み終了先	3,492,200					
超過準備	3,466,200					
非準備預金先	517,200					
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,107,700	
準備預金進捗率	実績		98.53%		日数	
					10.00%	

## ●2019年11月18日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、新積み期を迎えるも大手行や証券などの調達ニーズは限定的であり地銀業態中心の調達となった。朝方は、▲0.05%前後で出合うも、その後はやや幅広いレンジ▲0.08~▲0.04%で出合いが見られた。積み期序盤ということもあり、取り急ぐ動きは見られず、落ち着いた地合いとなった。ターム物は、ショートターム物で引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(11/19-11/20)は、▲0.08~▲0.06%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、新積み期に小幅低下。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.220%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は鉄鋼業態で900億円程度の大型案件が見られたことをはじめ、卸売や化学等の業態で比較的まとまった額の調達が行われ、発行総額は2,500億円程度と償還総額の1,400億円程度を上回った。発行レートについては、期越物や発行頻度が少ない銘柄で低下余地を探る動きも見られたが、全般的には横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/11/18	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	▲ 0.058				-	▲ 0.081	▲ 0.090	▲ 0.015	23,416.76	113.44	108.70-71	108.91-92
T/N							-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.024				-	▲ 0.079						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.031				-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.086						
1M							-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.220	▲ 0.124						
6M							▲ 0.217	▲ 0.170						
1Y							▲ 0.215	▲ 0.188						
									日付	11/11	11/12	11/13	11/14	11/15
									日銀当預残	4,046,500	4,058,000	4,049,800	4,049,600	4,041,000
									準備預金残	3,496,500	3,497,300	3,499,300	3,534,700	3,523,300
									マネタリーベース	5,168,200	5,179,200	5,170,200	5,170,600	5,161,900
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.070%	▲0.072%	▲0.074%	▲0.063%
									コール市場残高	91,318	84,972	94,987	107,534	104,622
									うち無担	76,293	70,128	78,985	85,356	82,845
									うちO/N	42,103	44,358	52,965	59,051	59,280
									うち有担	15,025	14,844	16,002	22,178	21,777

## ●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)
流動性供給	297	-	4,000	2019/11/19		15,344.0	3,980.0		▲0.0070%	42.6056%		▲0.0090%	

## ●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)		2019/11/18	2019/11/19	▲ 0.350	270	270		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/11/18	2019/11/19	▲ 0.350	5	5		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年11月19日の予定

\*米国10月の住宅着工件数

\*国庫短期証券(871回)入札  
(1年、19,000億円、11/20発行)

◆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