

# Central Daily Market Report

2019年11月20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20日		2019年11月21日		2019年11月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,100		▲ 2,000	
財政	5,700		▲ 11,800		1,000	
資金過不足	5,100		▲ 12,900		▲ 1,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	11,300					
CP等買入		▲ 100		▲ 200	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入				▲ 100		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	900		100		
当預増減	17,100		▲ 13,100		3,000	
当座預金残高	4,053,600		4,040,500		4,043,500	
準備預金残高	3,535,300					
積み終了先	3,530,300					
超過準備	3,529,500				11月21日以降の残り所要積立額 積数 20,600	
非準備預金先	518,300				1日平均 800	
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	99.34%	日数	16.67%		

## ●2019年11月20日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き一部の大手行や地銀業態からの調達ニーズが強く、レートは前日比で上昇した。朝方は▲0.05%を中心に▲0.055~▲0.04%の比較的狭いレンジで出合いが見られ、一巡後は▲0.07%台の出合いも見られた。ターム物は、ショートターム物で▲0.03%前後で引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(11/21-11/22)は、▲0.085%~▲0.075%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2Y 402~406、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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.230%、1Y物が▲0.204%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は機械や非鉄金属業態でまとまった額の発行が見られ、発行総額は1,700億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、発行残高が積み上がっている銘柄で僅かに上昇したが、全般的には横ばい圏で推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2019/11/20	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	▲ 0.070	0.030	▲ 0.047				-	▲ 0.081	▲ 0.114	▲ 0.019	23,148.57	▲ 144.08	108.47-48	108.43-44
T/N			0.001				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.230	0.007				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.220	▲ 0.128						
6M							▲ 0.210	▲ 0.169						
1Y							▲ 0.204	▲ 0.187						
									日付	11/13	11/14	11/15	11/18	11/19
									日銀当預残	4,049,800	4,049,600	4,041,000	4,042,600	4,036,500
									準備預金残	3,499,300	3,534,700	3,523,300	3,525,600	3,521,500
									マネタリーベース	5,170,200	5,170,600	5,161,900	5,162,800	5,156,600
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.074%	▲0.063%	▲0.058%	▲0.054%
									コール市場残高	94,987	107,534	104,622	96,210	99,351
									うち無担	78,985	85,356	82,845	74,414	78,902
									うちO/N	52,965	59,051	59,280	50,594	55,277
									うち有担	16,002	22,178	21,777	21,796	20,449

## ●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)
20年利付国債	170	0.30%	9,000	2019/11/21	2039/9/20	30,782.0	7,316.00	100.6000	0.2680%	43.6701%	100.6300	0.2660%	1,673.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/11/29	2020/5/29	318,759.0	10,500.16		0.0000%	3.2941%		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)		2019/11/20	2019/11/21	▲ 0.350	60	60		▲ 0.350	▲ 0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第103回	2019/11/22	2020/11/20	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第42回	2019/11/22	2020/11/20	0

## ●2019年11月21日の予定

\*米国10月の中古住宅販売

◆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お客様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