

Central Daily Market Report

2019年11月21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21日		2019年11月22日		2019年11月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 800		0	
財政	▲ 12,500		5,300		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 13,600		4,500		▲ 3,000	
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						▲ 4,500
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		▲ 200	4,000	▲ 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		▲ 100				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	▲ 14,000		9,600		▲ 7,500	
当座預金残高	4,039,600		4,049,200		4,041,700	
準備預金残高	3,516,700					
積み終了先	3,514,300				11月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,513,100				積数 17,000	
非準備預金先	522,900				1日平均 700	
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 99.45%		日数 20.00%			

●2019年11月21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▲0.04%を中心に▲0.05~▲0.03%の比較的狭いレンジで出合いが見られ、一巡後は▲0.06%台の出合いも見られた。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>

GC T/N(11/22-11/25)は、▲0.095~▲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、小幅低下。アウトライト市場では、短国買入オペが1,000億円(前回と同額)でオファーされ、平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差+0.002%とこじっかりとした結果となった。マーケットでも、3M物が▲0.240%、1Y物が▲0.205~▲0.204%出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は五・十日発行となり、卸売やノンバンク業態で比較的まとまった額の調達が行われ、発行総額は2,000億円程度と償還総額の1,000億円程度を上回った。発行レートについては、引き続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/11/21	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.083	▲ 0.115	▲ 0.001	23,038.58	▲ 109.99	108.47-48	108.57-58
T/N							-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.019				-	▲ 0.090						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.092						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.094						
1M	▲ 0.015	0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.240	▲ 0.129						
6M							▲ 0.210	▲ 0.169						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.187						
									日付	11/14	11/15	11/18	11/19	11/20
									日銀当預残	4,049,600	4,041,000	4,042,600	4,036,500	4,053,600
									準備預金残	3,534,700	3,523,300	3,525,600	3,521,500	3,535,300
									マネタリーベース	5,170,600	5,161,900	5,162,800	5,156,600	5,174,200
									無担O/N加重平均	▲0.074%	▲0.063%	▲0.058%	▲0.054%	▲0.047%
									コール市場残高	107,534	104,622	96,210	99,351	103,522
									うち無担	85,356	82,845	74,414	78,902	83,889
									うちO/N	59,051	59,280	50,594	55,277	61,564
									うち有担	22,178	21,777	21,796	20,449	19,633

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	2019/11/22			7,027	1,001	0.002		0.002	93.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/21	2019/11/22	▲ 0.350	216	216		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年11月22日の予定

*月例経済報告	*国庫短期証券(872回)入札 (3ヶ月、43,100億円、11/25発行)	*流動性供給入札 (6,000億円、11/25発行)
*10月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.4%		*交付税特別会計借入 (10,500億円、12/4借入)

◆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