

Central Daily Market Report

2019年11月22日(金)

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22日		2019年11月25日		2019年11月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		300		0	
財政	3,100		▲ 4,900		▲ 1,000	
資金過不足	2,200		▲ 4,600		▲ 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			6,200	▲ 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	4,000	▲ 100		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 400		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 900	200		900		
当預増減	6,400		▲ 2,800		▲ 1,000	
当座預金残高	4,046,000		4,043,200		4,042,200	
準備預金残高	3,528,800					
積み終了先	3,527,300					
超過準備	3,526,800					
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	99.65%	日数	30.00%		

●2019年11月22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いことに加え、週末の3日積みということもあり、レートは前日比で上昇した。朝方は▲0.03%を中心に▲0.035~▲0.02%のレンジで出会いが見られ、一巡後は▲0.06~▲0.04%の出会いも見られた。ターム物は、ショートターム物で▲0.02%台の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(11/25-11/26)は、▲0.08~▲0.07%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、上昇した。アウトライ市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.245~▲0.230%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.2263%、按分落札利回▲0.2103%と、WI取引ほどの強さは見られなかったもののしっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.223~▲0.220%の出会いが見られた。また、1Y物が▲0.205%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行案件数はさほど膨らまなかったものの、石油・石炭製品業態でまとまった額の調達が見られ、発行総額は1,100億円程度まで拡大。償還総額はゼロだったため、発行超のマーケットとなった。発行レートについては、0%近辺の低い水準で決着している。

●短期金融市場関連指標

2019/11/22	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.078	▲ 0.085	0.030	23,112.88	74.30	108.57-58	108.60-61
T/N							-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.023	▲ 0.015	▲ 0.021				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.083						
3W			0.001				-	▲ 0.090						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.223	▲ 0.129						
6M							▲ 0.210	▲ 0.169						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.187						
									日付	11/15	11/18	11/19	11/20	11/21
									日銀当預残	4,041,000	4,042,600	4,036,500	4,053,600	4,039,600
									準備預金残	3,523,300	3,525,600	3,521,500	3,535,300	3,516,800
									マネタリーベース	5,161,900	5,162,800	5,156,600	5,174,200	5,161,400
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.058%	▲0.054%	▲0.047%	▲0.039%
									コール市場残高	104,622	96,210	99,351	103,522	97,729
									うち無担	82,845	74,414	78,902	83,889	77,948
									うちO/N	59,280	50,594	55,277	61,564	49,173
									うち有担	21,777	21,796	20,449	19,633	19,781

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
国庫短期証券	872	-	43,100	2019/11/25	2020/3/2	95,101.1	35,171.7	100.0565	▲0.2103%	86.9957%	100.0608	▲0.2263%	7,928.0
流動性供給	298	-	6,000	2019/11/25		14,220.0	5,997.0		0.0350%	32.5714%		0.0300%	
交付税特会	-	-	10,500	2019/12/4	2020/6/3	276,947.0	10,500.25		0.0000%	3.7915%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/11/25	2019/12/9		6,216	6,216				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/22	2019/11/25	▲0.350	819	819		▲0.350	▲0.350	

●2019年11月25日の予定

9月の景気動向指数改訂状況

◆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