

# Central Daily Market Report

2019年11月25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25日		2019年11月26日		2019年11月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		▲ 400		▲ 1,000	
財政	▲ 4,600		1,100		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 4,500		700		▲ 5,000	
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						
国債買入			9,300			
CP等買入		▲ 400		▲ 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		▲ 400				
E T F 買入						
国債補完供給		900				
当預増減	▲ 2,700		9,900		▲ 5,000	
当座預金残高	4,043,300		4,053,200		4,048,200	
準備預金残高	3,524,400					
積み終了先	3,523,200					
超過準備	3,523,100					
非準備預金先	518,900					
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	99.69%	日数	33.33%		

## ●2019年11月25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。新積み期に入ってから、調達ニーズの強まりを受け前日比でのレート上昇が続いている。朝方は▲0.03%を中心に▲0.035~▲0.025%のレンジで出合いが見られ、一巡後は▲0.055~▲0.04%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(11/26-11/27)は、▲0.09~▲0.08%程度での出合い。SCはローラー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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.220~▲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400億円に対して、不動産、医薬品、小売業態等から大口の発行が実施されたため、発行総額は3,500億円強と大きく膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での決着となったが、一部銘柄でやや上昇する動きも見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2019/11/25	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	▲ 0.027				-	▲ 0.079	▲ 0.090	▲ 0.005	23,292.81	179.93	108.72-74	108.83-85
T/N	0.001	0.030	0.017				-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.079						
2W							-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.094						
3M	▲ 0.027	▲ 0.025	▲ 0.027				▲ 0.215	▲ 0.128						
6M							▲ 0.210	▲ 0.169						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.187						
									日付	11/18	11/19	11/20	11/21	11/22
									日銀当預残	4,042,600	4,036,500	4,053,600	4,039,600	4,046,000
									準備預金残	3,525,600	3,521,500	3,535,300	3,516,800	3,529,000
									マネタリーベース	5,162,800	5,156,600	5,174,200	5,161,400	5,168,700
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.054%	▲0.047%	▲0.039%	▲0.030%
									コール市場残高	96,210	99,351	103,522	97,729	101,591
									うち無担	74,414	78,902	83,889	77,948	81,601
									うちO/N	50,594	55,277	61,564	49,173	50,876
									うち有担	21,796	20,449	19,633	19,781	19,990

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/11/26			10,572	4,207	▲0.005		▲0.004	70.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/11/26			6,730	3,403	▲0.012		▲0.009	16.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2019/11/26			3,599	1,004	0.000		0.002	41.7
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/11/26			1,041	300	0.011		0.014	54.0
社債等買入	1000	2019/11/29			3,014	1,000	0.021		0.026	65.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/25	2019/11/26	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年11月26日の予定

*10月の企業向けサービス価格指数	*米国9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(4,000億円、11/27発行)
	*米国10月の新築一戸建て販売件数	
	*米国11月のCB消費者信頼感指数	

◆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