

Central Daily Market Report

2019年11月26日(火)

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26日		2019年11月27日		2019年11月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 600		▲ 2,000	
財政	▲ 200		▲ 6,900		0	
資金過不足	▲ 700		▲ 7,500		▲ 2,000	
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			1,000			
国債買入	9,300					
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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			300		
当預増減	8,200		▲ 6,400		▲ 2,000	
当座預金残高	4,051,500		4,045,100		4,043,100	
準備預金残高	3,510,800					
積み終了先	3,509,500				11月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,509,500				積数 8,500	
非準備預金先	540,700				1日平均 400	
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	99.73%	日数	36.67%		

●2019年11月26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、複数の先からプラスレートでの試し取りが行われたことから、レートは前日比で上昇した。朝方は▲0.025%を中心に▲0.03~▲0.02%のレンジで出合いが見られ、一巡後は▲0.06~▲0.05%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(11/27-11/28)は、▲0.08~▲0.07%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、横ばい圏で推移した。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)でオファーされた。平均落札利回較差+0.055%、按分落札利回較差+0.055%と弱めの結果となった。マーケットでは、閑散な中、3M物が▲0.210%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、2,100億円弱の償還に対して、発行総額は1,800億円強と償還超となったが、食料品・電力等からまとまった発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/11/26	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	▲ 0.070	0.030	▲ 0.018				-	▲ 0.081	▲ 0.100	▲ 0.010	23,373.32	80.51	108.99-00	108.95-96
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.023	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.078						
2W			▲ 0.018				-	▲ 0.080						
3W							-	▲ 0.087						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.215	▲ 0.124						
6M							▲ 0.210	▲ 0.168						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.187						
									日付	11/19	11/20	11/21	11/22	11/25
									日銀当預残	4,036,500	4,053,600	4,039,600	4,046,000	4,043,300
									準備預金残	3,521,500	3,535,300	3,516,800	3,529,000	3,524,400
									マネタリーベース	5,156,600	5,174,200	5,161,400	5,168,700	5,166,000
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.047%	▲0.039%	▲0.030%	▲0.027%
									コール市場残高	99,351	103,522	97,729	101,591	89,638
									うち無担	78,902	83,889	77,948	81,601	69,492
									うちO/N	55,277	61,564	49,173	50,876	42,877
									うち有担	20,449	19,633	19,781	19,990	20,146

●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)
40年利付国債	12	0.50%	4,000	2019/11/27	2059/3/20	13,994.0	3,996.00		0.4600%	73.5926%			

●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	2019/11/27			9,158	1,000		0.055	0.055	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/26	2019/11/27	▲ 0.350	286	286		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/11/29	2019/12/5	2.080	0	0				

●2019年11月27日の予定

*櫻井日銀審議委員、兵庫県金融経済懇談会において講演

*米国ページブック
*米国7-9月期のGDP改定値
*米国10月の耐久財新規受注
*米国10月の個人所得・消費支出

◆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