

Central Daily Market Report

2019年11月27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27日		2019年11月28日		2019年11月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 1,500		▲ 300	
財政	▲ 7,500		▲ 200		6,600	
資金過不足	▲ 8,200		▲ 1,700		6,300	
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			4,600			
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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	1,000	
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	▲ 7,400		2,800		7,300	
当座預金残高	4,044,100		4,046,900		4,054,200	
準備預金残高	3,517,400					
積み終了先	3,516,800					
超過準備	3,516,800				11月28日以降の残り所要積立額 積数 7,900	
非準備預金先	526,700				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	99.75%	日数	40.00%		

●2019年11月27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、地合いに特段の変化は見られなかった。昨日の試し取り要因が剥落し、加重平均レートは前日比で低下した。朝方は▲0.025%を中心に▲0.04~▲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(11/28-11/29)は、▲0.08~▲0.07%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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<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、月末発行にあたり、電機業態や機械業態等から大ロットの発行が実施されるなど幅広い企業が発行を行い活況であったが、償還総額1兆3,000億円強に対して、発行総額は1兆2,000億円弱にとどまる償還超となった。発行レートは引き続き0%付近の決着が中心となったが、年内物を中心に若干上昇する動きも見られた。

●短期金融市場関連指標

2019/11/27	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	▲ 0.023				-	▲ 0.075	▲ 0.115	▲ 0.015	23,437.77	64.45	109.09-10	109.18-19
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.023	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.077						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.079						
3W							-	▲ 0.086						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.215	▲ 0.122						
6M							▲ 0.210	▲ 0.168						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.187						
									日付	11/20	11/21	11/22	11/25	11/26
									日銀当預残	4,053,600	4,039,600	4,046,000	4,043,300	4,051,500
									準備預金残	3,535,300	3,516,800	3,529,000	3,524,400	3,511,500
									マネタリーベース	5,174,200	5,161,400	5,168,700	5,166,000	5,174,600
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.039%	▲0.030%	▲0.027%	▲0.018%
									コール市場残高	103,522	97,729	101,591	89,638	110,284
									うち無担	83,889	77,948	81,601	69,492	90,662
									うちO/N	61,564	49,173	50,876	42,877	62,647
									うち有担	19,633	19,781	19,990	20,146	19,622

●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年以下)	500	2019/11/28			1,308	500	0.012		0.027	74.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/11/28			10,377	3,510	▲0.010		▲0.009	42.3
国債買入(物価連動債)	300	2019/11/28			1,523	303	▲0.010		▲0.098	34.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/27	2019/11/28	▲ 0.350	287	287		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年11月28日の予定

*10月の商業動態統計速報	*New York祝日(Thanksgiving Day)	*2年利付国債入札(20,000億円、12/2発行)
---------------	-------------------------------	----------------------------

◆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