

Central Daily Market Report

2019年11月28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28日		2019年11月29日		2019年12月2日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	
銀行券	▲ 1,600	▲ 1,100				0
財政	▲ 200	1,800				▲ 30,000
資金過不足	▲ 1,800	700				▲ 30,000
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						
国債買入	4,600					
CP等買入		▲ 300		▲ 800		
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	2,400		1,200			▲ 30,000
当座預金残高	4,046,500		4,047,700			4,017,700
準備預金残高	3,524,900					
積み終了先	3,523,600				11月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,523,600				積数	6,600
非準備預金先	521,600				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	99.79%	日数	43.33%		

●2019年11月28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、前日と概ね横ばいで推移した。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%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(11/29-12/2)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、3M物が▲0.213%、1Y物が▲0.201~▲0.195%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、二営業日後が月初の発行にあたり、300億円程度の償還に対して、発行は3,100億円程度に膨らみ、鉄鋼、機械などからは大型発行も実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/11/28	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.024				-	▲ 0.078	▲ 0.095	0.020	23,409.14	▲ 28.63	109.37-38	109.41-42
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.023				-	▲ 0.077						
2W			▲ 0.023				-	▲ 0.079						
3W							-	▲ 0.085						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.213	▲ 0.121						
6M							▲ 0.207	▲ 0.168						
1Y							▲ 0.201	▲ 0.187						
									日付	11/21	11/22	11/25	11/26	11/27
									日銀当預残	4,039,600	4,046,000	4,043,300	4,051,500	4,044,100
									準備預金残	3,516,800	3,529,000	3,524,400	3,511,500	3,517,700
									マネタリーベース	5,161,400	5,168,700	5,166,000	5,174,600	5,167,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.030%	▲ 0.027%	▲ 0.018%	▲ 0.023%
									コール市場残高	97,729	101,591	89,638	110,284	96,751
									うち無担	77,948	81,601	69,492	90,662	76,469
									うちO/N	49,173	50,876	42,877	62,647	49,954
									うち有担	19,781	19,990	20,146	19,622	20,282

●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)
2年利付国債	407	0.10%	20,000	2019/12/2	2021/12/1	68,759.0	16,649.0	100.5700	▲0.1830%	69.1516%	100.5810	▲0.1890%	3,346.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/28	2019/11/29	▲ 0.350	258	258		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/11/28	2019/11/29	▲ 0.350	10	10		▲ 0.350	▲ 0.350	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数					
成長基盤強化	本則第38回	2019/12/4	0	10,258	41					
成長基盤強化	米ドル特別第30期	2019/12/4		342	19					
成長基盤強化	米ドル特別第26期(借り換え)	2019/12/4		732	18					
成長基盤強化	米ドル特別第22期(借り換え)	2019/12/4		569	18					
成長基盤強化	米ドル特別第18期(借り換え)	2019/12/4		3,646	29					

●2019年11月29日の予定

*10月の完全失業率(市場予想:2.4%)	*10月の有効求人倍率(市場予想:1.56倍)	*米国11月のシカゴPM景況感指数
*11月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.6%)	*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲2.1%)	*ユーロ圏11月の消費者物価指数速報値
*10月の住宅着工統計	*11月の消費動向調査	*国庫短期証券(873回)入札(3ヶ月、42,800億円、12/2発行)

◆本資料は信頼できるとさ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