

Central Daily Market Report

2019年11月29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29日		2019年12月2日		2019年12月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		0		▲ 1,000	
財政	1,300		▲ 30,100		▲ 14,000	
資金過不足	100		▲ 30,100		▲ 15,000	
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						
CP等買入		▲ 800		▲ 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	1,000					
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 500	300		500		
当預増減	100		▲ 29,700		▲ 15,000	
当座預金残高	4,046,600		4,016,900		4,001,900	
準備預金残高	3,525,800					
積み終了先	3,525,500		12月2日以降の残り所要積立額		積数 5,400	
超過準備	3,525,400		1日平均		400	
非準備預金先	520,800					
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,111,500	
準備預金進捗率	実績	99.83%	日数	53.33%		

●2019年11月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、月末を迎えたことで一部の先から調達を控える動きが見られた。昨日に比べ調達ニーズが限定的となったことでレートは前日比で低下した。朝方は▲0.05～▲0.025%のレンジでの出会い、一巡後は▲0.08～▲0.06%が出合うなどレートの低下が見られた。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(12/2-12/3)は、▲0.08～▲0.05%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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.200～▲0.175%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1783%、按分落札利回▲0.1507%と、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.165～▲0.150%と軟調な推移となった。

<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、償還総額は200億円程度と少額であったが、石油業態などから大型案件が実施され、発行総額は1,100億円程度となった。発行レートは概ね横ばいであった。

●短期金融市場関連指標

2019/11/29	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.071	▲ 0.085	0.010	23,293.91	▲ 115.23	109.51-52	109.49-50
T/N							-	▲ 0.064						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.067						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.068						
3W							-	▲ 0.077						
1M							-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.155	▲ 0.120						
6M							▲ 0.207	▲ 0.167						
1Y							▲ 0.201	▲ 0.187						
									日付	11/22	11/25	11/26	11/27	11/28
									日銀当預残	4,046,000	4,043,300	4,051,500	4,044,100	4,046,500
									準備預金残	3,529,000	3,524,400	3,511,500	3,517,700	3,524,900
									マネタリーベース	5,168,700	5,166,000	5,174,600	5,167,900	5,172,100
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.027%	▲0.018%	▲0.023%	▲0.024%
									コール市場残高	101,591	89,638	110,284	96,751	98,237
									うち無担	81,601	69,492	90,662	76,469	77,628
									うちO/N	50,876	42,877	62,647	49,954	51,173
									うち有担	19,990	20,146	19,622	20,282	20,609

●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)
国庫短期証券	873	-	42,800	2019/12/2	2020/3/9	116,539.1	34,932.6	100.0405	▲0.1507%	25.1912%	100.0479	▲0.1783%	7,867.0

●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)		2019/11/29	2019/12/2	▲ 0.350	527	527		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年12月2日の予定

*7-9月期の法人企業統計調査季報

*米国10月の建設支出

*米国11月のISM製造業景況指数

◆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