

# Central Daily Market Report

2019年11月6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6日		2019年11月7日		2019年11月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000	▲100				0
財政	▲1,600	▲20,500	▲1,000	▲20,600	▲1,000	▲1,000
資金過不足	▲600	▲20,600	▲1,000	▲20,600	▲1,000	▲1,000
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	9,200					
CP等買入						
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		200				
当預増減	8,800	▲19,600	▲1,000	▲19,600	▲1,000	▲1,000
当座預金残高	4,080,400	4,060,800	4,059,800	4,060,800	4,059,800	4,059,800
準備預金残高	3,535,200					
積み終了先	3,534,900					
超過準備	3,534,900					
非準備預金先	545,200					
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額						3,193,600
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	70.97%		

## ●2019年11月6日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き一部で調達水準を引き下げる動きが見られ、レートは僅かに低下した。立ち上がりは国内勢を中心に▲0.04~▲0.025%の出会い。一巡後は▲0.045~▲0.03%の出会いが見られた。ターム物は、ショートターム物の出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(11/7-11/8)は、▲0.105~▲0.090%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2Y402~405、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、小幅低下した。アウトライト市場は、3M物が▲0.175~▲0.170%でまとまった出会いが見られた。また、引け際に1Y物が▲0.205%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額700億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と若干の発行超であった。案件数は膨らんだものの、小型案件を中心とする落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/11/6	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	▲0.080	0.001	▲0.031				-	▲0.102	▲0.090	0.050	23,303.82	51.83	109.14-15	108.97-98
T/N	▲0.050	▲0.035	▲0.040				-	▲0.096						
S/N							-	-						
1W			▲0.025				-	▲0.088						
2W	▲0.020	▲0.001	▲0.019				-	▲0.090						
3W							-	▲0.093						
1M			▲0.020				-	▲0.097						
3M			0.060				▲0.170	▲0.124						
6M							▲0.200	▲0.167						
1Y							▲0.205	▲0.192						
									日付	10/29	10/30	10/31	11/1	11/5
									日銀当預残	4,109,100	4,108,300	4,106,100	4,076,500	4,071,600
									準備預金残	3,578,700	3,572,500	3,563,800	3,534,500	3,538,900
									マネタリーベース	5,231,700	5,231,300	5,230,300	5,201,500	5,196,000
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.024%	▲0.030%	▲0.024%	▲0.027%
									コール市場残高	96,753	97,659	94,239	103,771	97,448
									うち無担	77,200	77,828	74,425	83,920	77,597
									うちO/N	51,675	53,053	53,760	60,905	53,577
									うち有担	19,553	19,831	19,814	19,851	19,851

## ●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)
10年利付国債	356	0.10%	21,000	2019/11/7	2029/9/20	61,758.0	17,055.00	101.9400	▲0.0940%	80.6774%	101.9900	▲0.0990%	3,939.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/11/15	2020/5/15	271,206.0	10,500.03		0.0000%	3.8717%		0.0000%	

## ●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	2019/11/7			8,157	1,000	0.031		0.040	49.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/6	2019/11/7	▲0.350	13	13		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/11/6	2019/11/7	▲0.350	17	17		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年11月7日の予定

*英中銀MPC結果発表	*国庫短期証券(868回)入札
*米国9月の消費者信用残高	(6ヶ月、23,000億円、11/11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お客様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