Central Daily Market Report

2019年11月7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7日 需給速報		2019年11月8日 需給予想		2019年11月11日 当社予想	
銀行券	0		400		1,000	
財政	▲ 21,600		1,400		▲ 14,000	
資金過不足	▲ 21,600		1,800		▲ 13,000	
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						▲ 5,600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入						
CP等買入				▲ 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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給						
当預増減	▲ 20,600		1,500		▲ 18,600	

当座預金残高	4,059,800	4,061,300	4,042,700
準備預金残高	3,514,900		
積み終了先	3,514,700		
超過準備	3,514,700		
非準備預金先	544,900		

11月8日以降の残り所要積立額	
積数	1,500
1日平均	200

積み期間（10/16～11/15）の所要準備額			3,197,900
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数 74.19%

●2019年11月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続きレートは低下基調となった。立ち上がりは邦銀・証券業態の調達を中心に▲0.045～▲0.025%の出合い。一巡後は更にレート低下し、▲0.06～▲0.05%の出合いも散見された。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(11/8-11/11)は、▲0.120～▲0.095%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2Y402～405、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、低下した。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.150～▲0.140%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1563%、按分落札利回▲0.1462%と、前回債からレートが上昇する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.210～▲0.180%と強めの出合いが見られた。

<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1,300億円程度に対して、発行総額は1,100億円程度と若干の償還超であった。一部の鉄鋼業態から大型の発行が見られたものの、案件数が少なく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

2019/11/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.038				－	▲ 0.103
T/N	▲ 0.050	▲ 0.035	▲ 0.040				－	▲ 0.116
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.024				－	▲ 0.105
2W							－	▲ 0.101
3W							－	▲ 0.102
1M							－	▲ 0.104
3M							▲ 0.170	▲ 0.124
6M							▲ 0.190	▲ 0.167
1Y							▲ 0.205	▲ 0.191

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.090	0.000	23,330.32	26.50	108.91-93	108.95-97

日付	10/30	10/31	11/1	11/5	11/6
日銀当預残	4,108,300	4,106,100	4,076,500	4,071,600	4,080,400
準備預金残	3,572,500	3,563,800	3,534,500	3,538,900	3,536,100
マネタリーベース	5,231,300	5,230,300	5,201,500	5,196,000	5,203,800
無担O/N加重平均	▲0.024%	▲0.030%	▲0.024%	▲0.027%	▲0.031%
コール市場残高	97,659	94,239	103,771	97,448	97,930
うち無担	77,828	74,425	83,920	77,597	79,599
うちO/N	53,053	53,760	60,905	53,577	56,604
うち有担	19,831	19,814	19,851	19,851	18,331

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	868	－	23,000	2019/11/11	2020/5/11	96,170.0	18,775.7	100.0730	▲0.1462%	23.1542%	100.0780	▲0.1563%	4,224.0

●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）		2019/11/7	2019/11/8	▲ 0.350	15	15		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2019/11/7	2019/11/8	▲ 0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	

●2019年11月8日の予定

*9月の全世帯家計調査
（市場予想：消費支出、前年比＋7.8%）
*9月の毎月勤労統計調査速報
*9月の景気動向指数速報
*10月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*米国9月の卸売売上高
*米国11月のミシガン大消費者信頼感指数速報
*国庫短期証券（869回）入札
（3ヶ月、42,700億円、11/11発行）
*10年物価連動国債入札
（4,000億円、11/11発行）
*エネルギー対策借入
（6,500億円、11/20借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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