

Central Daily Market Report

2019年11月15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15日		2019年11月18日		2019年11月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		800		0	
財政	▲ 7,500		▲ 2,400		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 7,300		▲ 1,600		▲ 4,000	
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			1,500			
CP等買入		▲ 900		▲ 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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400		400			
当預増減	▲ 8,600		200		▲ 4,000	
当座預金残高	4,041,000		4,041,200		4,037,200	
準備預金残高	3,523,100					
積み終了先	3,523,100				11月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,523,100				積数 105.000	
非準備預金先	517,900				1日平均 3.800	
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		96.62%		日数 6.67%	

●2019年11月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、積み最終日や来積み期間に係る取引であったことから、幅広い業態で調達が見られた。朝方は徐々に取り上がる展開で、▲0.075~▲0.05%の出会い。一巡後も幅広いレンジでの取り調整の動きが見られた。ターム物は1~2W物の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(11/18-11/19)は、▲0.08~▲0.06%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▲0.220~▲0.215%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.2137%、按分落札利回▲0.1989%と、WI取引を反映して落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.220~▲0.210%の出会いと堅調に推移した。

<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200億円強に対して、発行総額1,000億円強となった。小売業態等から大型発行が実施され、発行総額は膨らんだ。発行レートは一部で若干上昇する動きも見られたが、総じて横ばい圏での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2019/11/15	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	▲ 0.063				-	▲ 0.075	▲ 0.075	0.000	23,303.32	161.77	108.49-50	108.55-56
T/N							-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.075						
2W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.026				-	▲ 0.077						
3W							-	▲ 0.084						
1M	▲ 0.030	0.010	▲ 0.028				-	▲ 0.090						
3M			▲ 0.010				-	▲ 0.124						
6M							▲ 0.220	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.217	▲ 0.170						
							▲ 0.215	▲ 0.188						
									日付	11/8	11/11	11/12	11/13	11/14
									日銀当預残	4,061,800	4,046,500	4,058,000	4,049,800	4,049,600
									準備預金残	3,519,700	3,496,500	3,497,300	3,499,300	3,534,700
									マネタリーベース	5,184,700	5,168,200	5,179,200	5,170,200	5,170,600
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.065%	▲0.070%	▲0.072%	▲0.074%
									コール市場残高	105,877	91,318	84,972	94,987	107,534
									うち無担	87,485	76,293	70,128	78,985	85,356
									うちO/N	54,545	42,103	44,358	52,965	59,051
									うち有担	18,392	15,025	14,844	16,002	22,178

●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	870	-	43,200	2019/11/18	2020/2/25	130,777.1	35,260.8	100.0540	▲0.1989%	68.2137%	100.0580	▲0.2137%	7,939.0
国有林野借入	-	-	818	2019/11/25	2024/11/25	2,955.0	818.00		0.0000%	50.0000%		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
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2019/11/18			4,962	1,009	▲0.013		▲0.013	79
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/11/18			1,078	303	▲0.014		▲0.013	100.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/15	2019/11/18	▲0.350	351	351		▲0.350	▲0.350	

●2019年11月18日の予定

*流動性供給入札
(4,000億円、11/19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