

# Central Daily Market Report

2019年11月19日(火)

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19日		2019年11月20日		2019年11月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 500		▲ 1,000	
財政	▲ 5,600		5,000		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 5,400		4,500		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,300			
CP等買入		▲ 100		▲ 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	▲ 900	300		900		
当預増減	▲ 6,100		16,600		▲ 13,000	
当座預金残高	4,036,500		4,053,100		4,040,100	
準備預金残高	3,521,500					
積み終了先	3,514,800					
超過準備	3,502,000					
非準備預金先	515,000					
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	99.15%	日数	13.33%		

## ●2019年11月19日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前日に調達を控えていた一部の業態からのビッドが見られたことや、一部の先で試し取りが見られたため、レートは前日比で上昇した。朝方は▲0.06%を中心に▲0.07~▲0.04%のレンジで出合いが見られ、一巡後は▲0.08%台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(11/20-11/21)は、▲0.08~▲0.07%程度での出合い。SCはローラー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。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.210~▲0.200%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.2000%、按分落札利回▲0.1911%と、前回債からレートが低下する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.203~▲0.200%の出合いが見られた。この他に、3M物が▲0.219%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場はノンバンク、電気・ガス、卸売業態で比較的多まった額の調達が見られたものの、発行総額は1,000億円程度で償還総額の1,200億円程度を下回った。発行レートについては、希少銘柄でレートを切り下げる動きも見られたが、全般的には0%近辺の狭いレンジで推移した。本日はCP等買入オベが4,000億円オファーされた。結果は平均落札レート0.001%、按分落札レート▲0.002%と、前回(平均0.000%、按分▲0.001%)比で平均レートは上昇、按分レートは低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/11/19	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	▲ 0.085	0.030	▲ 0.054				-	▲ 0.079	▲ 0.095	▲ 0.005	23,292.65	▲ 124.11	108.67-68	108.66-67
T/N			0.030				-	▲ 0.078						
S/N			0.001				-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.080						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.081						
3W	0.000	0.001	0.001				-	▲ 0.085						
1M							-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.220	▲ 0.124						
6M							▲ 0.205	▲ 0.168						
1Y							▲ 0.203	▲ 0.187						
									日付	11/12	11/13	11/14	11/15	11/18
									日銀当預残	4,058,000	4,049,800	4,049,600	4,041,000	4,042,600
									準備預金残	3,497,300	3,499,300	3,534,700	3,523,300	3,525,600
									マネタリーベース	5,179,200	5,170,200	5,170,600	5,161,900	5,162,800
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.072%	▲0.074%	▲0.063%	▲0.058%
									コール市場残高	84,972	94,987	107,534	104,622	96,210
									うち無担	70,128	78,985	85,356	82,845	74,414
									うちO/N	44,358	52,965	59,051	59,280	50,594
									うち有担	14,844	16,002	22,178	21,777	21,796

## ●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	871	-	19,000	2019/11/20	2020/11/20	57,972.0	15,516.7	100.1920	▲0.1911%	44.8717%	100.2010	▲0.2000%	3,483.0

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/11/20			8,512	4,202	▲0.004		▲0.001	54.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/11/20			11,272	3,407	▲0.009		▲0.008	93.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/11/20			10,489	3,510	▲0.008		▲0.007	50.6
CP等買入	4000	2019/11/22			7,135	3,990	▲0.002		0.001	56.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/19	2019/11/20	▲0.350	864	864		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/11/21	2019/11/29	2.070	0	0				

## ●2019年11月20日の予定

*10月の貿易統計	*20年利付国債入札(9,000億円、11/21発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/29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