

# Central Daily Market Report

2019年10月4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10月4日		2019年10月7日		2019年10月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		1,000		1,000	
財政	▲ 4,400		3,300		0	
資金過不足	▲ 3,800		4,300		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			1,600	▲ 3,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,600			
CP等買入				▲ 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	200		900		
当預増減	▲ 4,500		8,200		1,000	
当座預金残高	3,995,400		4,003,600		4,004,600	
準備預金残高	3,502,300					
積み終了先	3,502,100				10月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,501,900				積数	
非準備預金先	493,100				1日平均	
					100	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,085,600	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	70.00%		

## ●2019年10月4日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀を中心に▲0.015~▲0.005%の出合い。レポ金利の高止まりや週末要因などもあって昨日よりも調達意欲は一層強く、一巡後の出合い水準は▲0.02~▲0.015%程度で推移した。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(10/7-10/8)は、▲0.06~▲0.04%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、10Y335~356、5Y136~140、30Y59~63、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は、小幅上昇。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▲0.380~▲0.375%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.3657%、按分落札利回▲0.3333%とWI取引ほどの強さは見られない結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.360~▲0.358%出合いと堅調に推移した。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額500億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と発行超であった。卸売・その他金融業態において大型発行が見られ、案件は少なかったものの、月初旬の発行としてはやや活況な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

2019/10/4	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.049	▲ 0.215	▲ 0.020	21,410.20	68.46	106.82-84	106.76-78
T/N							-	▲ 0.048						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.057						
2W							-	▲ 0.064						
3W			0.000				-	▲ 0.074						
1M							-	▲ 0.087						
3M							▲ 0.358	▲ 0.166						
6M							▲ 0.305	▲ 0.186						
1Y							▲ 0.301	▲ 0.204						
									日付	9/27	9/30	10/1	10/2	10/3
									日銀当預残	4,086,800	4,084,100	4,067,300	4,000,100	3,999,900
									準備預金残	3,550,400	3,553,400	3,540,000	3,497,200	3,485,500
									マネタリーベース	5,207,800	5,204,800	5,187,300	5,119,500	5,119,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.064%	▲ 0.048%	▲ 0.036%	▲ 0.019%
									コール市場残高	109,914	75,098	98,530	100,175	94,725
									うち無担	88,919	60,524	77,448	78,799	74,650
									うちO/N	59,374	45,044	56,643	58,194	52,010
									うち有担	20,995	14,574	21,082	21,376	20,075

## ●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	861	-	42,700	2019/10/7	2020/1/14	130,244.0	34,981.8	100.0905	▲0.3333%	27.5538%	100.0993	▲0.3657%	7,718.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/10/7	2019/10/21		1,598	1,598				
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/10/7			1,719	500	0.015		0.030	17.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/10/7			11,484	3,506	▲0.024		▲0.022	17.1
国債買入(物価連動債)	250	2019/10/7			1,863	250	▲0.080		▲0.148	10.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/4	2019/10/7	▲ 0.250	848	848		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/10/4	2019/10/7	▲ 0.250	1	1		▲ 0.250	▲ 0.250	

## ●2019年10月7日の予定

*8月の景気動向指数速報	*米国8月の消費者信用残高
*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引	

◆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