

Central Daily Market Report

2019年10月7日(月)
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7日 需給速報	2019年10月8日 需給予想	2019年10月9日 当社予想	
銀行券	900	600	0	
財政	5,200	▲500	▲5,000	
資金過不足	6,100	100	▲5,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	
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	9,300		
CP等買入		▲100	▲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				
E T F 買入				
国債補完供給	▲200	900	200	
当預増減	9,800	9,300	▲5,000	
当座預金残高	4,005,200	4,014,500	4,009,500	
準備預金残高	3,488,700			
積み終了先	3,488,500			
超過準備	3,488,500			
非準備預金先	516,500			
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額			3,090,800	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	73.33%

●2019年10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、邦銀を中心に▲0.015~▲0.005%の出会いで始まった。先週末の地合いを引き継いで高水準の出会いとなり、一巡後は▲0.02~▲0.01%と横ばい圏で推移した。ターム物に関しては特段目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(10/8-10/9)は、▲0.045~▲0.04%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2Y402~404、10Y335~356、5Y136~140、20Y167~169、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、横ばい圏で推移した。アウトライ市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.358%で出合った。

<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、償還は少額であったが、商社から大型発行が実施されたため、発行件数は少なかったものの総額では1,100億円程度の発行となった。発行レートは概ね横ばいでの推移となった。

●短期金融市場関連指標

2019/10/7	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲0.040	0.001	▲0.012				-	▲0.046	▲0.230	▲0.015	21,375.25	▲34.95	106.76-77	106.84-85
T/N							-	▲0.046						
S/N							-	-						
1W	▲0.010	0.001	▲0.007				-	▲0.052						
2W			▲0.020				-	▲0.064						
3W			0.000				-	▲0.072						
1M			▲0.015				-	▲0.085						
3M			▲0.020				▲0.368	▲0.166						
6M							▲0.310	▲0.184						
1Y							▲0.296	▲0.201						
									日付	9/30	10/1	10/2	10/3	10/4
									日銀当預残	4,084,100	4,067,300	4,000,100	3,999,900	3,995,400
									準備預金残	3,553,400	3,540,000	3,497,200	3,485,500	3,502,400
									マネタリーベース	5,204,800	5,187,300	5,119,500	5,119,400	5,114,300
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.048%	▲0.036%	▲0.019%	▲0.011%
									コール市場残高	75,098	98,530	100,175	94,725	107,610
									うち無担	60,524	77,448	78,799	74,650	87,025
									うちO/N	45,044	56,643	58,194	52,010	63,065
									うち有担	14,574	21,082	21,376	20,075	20,585

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	2019/10/8			14,669	4,204	0.002		0.003	86.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/10/8			8,259	3,401	▲0.009		▲0.007	40.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2019/10/8			4,731	1,203	0.000		0.000	99.1
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/10/8			1,253	301	0.003		0.004	27.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/7	2019/10/8	▲0.250	210	210		▲0.250	▲0.250	

●2019年10月8日の予定

*8月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+1.2%)	*米国9月の生産者物価指数	*流動性供給入札(6,000億円、10/9発行)
*8月の国際収支		*交付税特別会計借入(10,500億円、10/18借入)
*9月の毎月勤労統計調査速報		
*9月の景気ウォッチャー調査		

◆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