

Central Daily Market Report

2019年10月8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10月8日		2019年10月9日		2019年10月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		600		▲ 1,000	
財政	▲ 3,900		▲ 3,300		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 3,400		▲ 2,700		▲ 5,000	
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			1,000			
国債買入	9,300					
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
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			100			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	5,700		▲ 1,700		▲ 5,000	
当座預金残高	4,010,900		4,009,200		4,004,200	
準備預金残高	3,493,800					
積み終了先	3,493,600				10月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,493,600				積数 900	
非準備預金先	517,100				1日平均 100	
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	99.97%	日数	76.67%		

●2019年10月8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。昨日に続き資金調達サイドから取り上がる動きも見られた。一巡後もほぼ同水準の▲0.015～▲0.01%程度で推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては目立った出合いが見られなかった。

＜レポ市場＞

GCT/N(10/9-10/10)は、▲0.06～▲0.05%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2Y402～404、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、低下した。アウトライト市場では、短国買入オペが1,000億円(前回と同額)でオファーされた。オペ通告後に1Y物が▲0.296～▲0.293%での出合いが見られる中、平均落札利回較差+0.016%、全取落札利回較差+0.016%と在庫調整の売りから弱めの結果となった。その後のマーケットでも、6M物が▲0.308%出合いと小甘く推移した。3M物は▲0.368%での出合いだった。

＜CP市場＞

現先レートは低位横ばい圏で推移した。CP発行市場は五・十日発行にあたるため、800億円強の償還に対して、2,300億円程度の発行となり、発行がやや膨らんだ。商社業態では大型発行も実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/10/8	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	▲ 0.012				-	▲ 0.050	▲ 0.205	0.025	21,587.78	212.53	107.25-26	107.15-17
T/N							-	▲ 0.057						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.009				-	▲ 0.060						
2W							-	▲ 0.070						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.077						
1M							-	▲ 0.089						
3M			▲ 0.045				▲ 0.368	▲ 0.168						
6M							▲ 0.305	▲ 0.186						
1Y							▲ 0.296	▲ 0.205						
									日付	10/1	10/2	10/3	10/4	10/7
									日銀当預残	4,067,300	4,000,100	3,999,900	3,995,400	4,005,200
									準備預金残	3,540,000	3,497,200	3,485,500	3,502,400	3,485,800
									マネタリーベース	5,187,300	5,119,500	5,119,400	5,114,300	5,123,200
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.036%	▲0.019%	▲0.011%	▲0.012%
									コール市場残高	98,530	100,175	94,725	107,610	95,441
									うち無担	77,448	78,799	74,650	87,025	75,741
									うちO/N	56,643	58,194	52,010	63,065	52,766
									うち有担	21,082	21,376	20,075	20,585	19,700

●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)
流動性供給	296	-	6,000	2019/10/9		16,041.0	5,985.0		0.0140%	54.3325%		0.0120%	
交付税特会	-	-	10,500	2019/10/18	2020/4/17	308,940.0	10,500.09		0.0000%	3.3988%		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
国庫短期証券買入	1,000	2019/10/9			4,735	1,000		0.016	0.016	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/8	2019/10/9	▲ 0.250	52	52		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/10/8	2019/10/9	▲ 0.250	4	4		▲ 0.250	▲ 0.250	
米ドル資金供給		2019/10/10	2019/10/18	2.340	0	0				

●2019年10月9日の予定

*米国8月の卸売売上高	*国庫短期証券(862回)入札 (6ヶ月、23,000億円、10/10発行)
-------------	---

◆本資料は信頼できるとさ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