

Central Daily Market Report

2019年10月9日(水)
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9日		2019年10月10日		2019年10月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 3,400		▲ 6,300		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 2,900		▲ 7,400		▲ 6,000	
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						
CP等買入		▲ 200		▲ 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	100					
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 1,900		▲ 7,500		▲ 6,000	
当座預金残高	4,009,000		4,001,500		3,995,500	
準備預金残高	3,499,500					
積み終了先	3,499,300				10月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,499,300				積数	
非準備預金先	509,500				1日平均	
					700	
					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	99.98%	日数	80.00%		

●2019年10月9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~▲0.01%の出会い。積み終盤による調整の調達からレートは引き続き高止まりが見られた。一巡後は▲0.02~▲0.015%程度で推移し、本日の取引を終了した。ターム物については、出会いは閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(10/10-10/11)は、▲0.06~▲0.04%程度での出会い。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2Y402~404、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。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.310~▲0.295%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.2967%、按分落札利回▲0.2708%とWI取引ほどの強さは見られず、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.290~▲0.286%出会いと底堅く推移した。この他に、3M物について▲0.365~▲0.360%でのまとまった出会いが見られた。

<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、発行・償還ともに1,200億円弱の規模となり、商社からまとまったロットでの発行が見られた。発行レートは引き続き0%付近での決着が中心となっている。

●短期金融市場関連指標

2019/10/9	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				-	▲ 0.064	▲ 0.210	▲ 0.005	21,456.38	▲ 131.40	106.94-96	107.21-22
T/N							-	▲ 0.063						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.067						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.077						
3W							-	▲ 0.082						
1M							-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.364	▲ 0.170						
6M							▲ 0.288	▲ 0.181						
1Y							▲ 0.296	▲ 0.198						
									日付	10/2	10/3	10/4	10/7	10/8
									日銀当預残	4,000,100	3,999,900	3,995,400	4,005,200	4,010,900
									準備預金残	3,497,200	3,485,500	3,502,400	3,485,800	3,493,800
									マネタリーベース	5,119,500	5,119,400	5,114,300	5,123,200	5,128,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.036%	▲ 0.019%	▲ 0.011%	▲ 0.012%	▲ 0.012%
									コール市場残高	100,175	94,725	107,610	95,441	102,259
									うち無担	78,799	74,650	87,025	75,741	82,323
									うちO/N	58,194	52,010	63,065	52,766	59,673
									うち有担	21,376	20,075	20,585	19,700	19,936

●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	862	-	23,000	2019/10/10	2020/4/10	86,177.0	18,957.5	100.1360	▲0.2708%	26.6666%	100.1490	▲0.2967%	4,042.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/9	2019/10/10	▲ 0.350	45	45		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年10月10日の予定

*雨宮日銀副総裁、ASIFMA・Annual Conferenceにおいて講演	*米国9月の消費者物価指数	*30年利付国債入札(7,000億円、10/11発行)
*8月の機械受注統計(市場予想:船舶、電力除く民需、前月比▲2.5%)	*米国9月の財政収支	*エネルギー対策借入(6,500億円、10/21借入)
*8月の特定サービス産業動態統計速報		
*9月の企業物価指数		

◆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