

Central Daily Market Report

2019年10月10日(木)

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10日		2019年10月11日		2019年10月15日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 700				0
財政	▲ 6,400	▲ 8,000				84,000
資金過不足	▲ 7,600	▲ 8,700				84,000
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						▲ 2,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
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				700		
国債補完供給						
当預増減	▲ 7,700	▲ 8,400				81,800
当座預金残高	4,001,300	3,992,900	4,001,300	3,992,900	4,074,700	4,074,700
準備預金残高	3,483,500		3,483,500		3,483,500	
積み終了先	3,483,300		3,483,300		3,483,300	
超過準備	3,483,300		3,483,300		3,483,300	
非準備預金先	517,800		517,800		517,800	
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	83.33%		

●2019年10月10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%の出会いとなった。昨日の地合いを引き継いで高水準の出会いは続き、一巡後は▲0.015~▲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>

GC T/N(10/11~10/15)は、▲0.07~▲0.055%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、小幅低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散で、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、15日発行にあたり、建設・ゴム業態で大型発行が観測され、償還総額2,900億円程度に対して、発行総額は3,300億円程度と発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/10/10	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.052	▲ 0.215	▲ 0.005	21,551.98	95.60	107.22-24	107.40-42
T/N							-	▲ 0.063						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.068						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.078						
3W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.085						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.360	▲ 0.171						
6M							▲ 0.288	▲ 0.181						
1Y							▲ 0.296	▲ 0.197						
									日付	10/3	10/4	10/7	10/8	10/9
									日銀当預残	3,999,900	3,995,400	4,005,200	4,010,900	4,009,000
									準備預金残	3,485,500	3,502,400	3,485,800	3,493,800	3,499,500
									マネタリーベース	5,119,400	5,114,300	5,123,200	5,128,500	5,126,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.011%	▲ 0.012%	▲ 0.012%	▲ 0.012%
									コール市場残高	94,725	107,610	95,441	102,259	96,928
									うち無担	74,650	87,025	75,741	82,323	78,791
									うちO/N	52,010	63,065	52,766	59,673	56,011
									うち有担	20,075	20,585	19,700	19,936	18,137

●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)
30年利付国債	64	0.40%	7,000	2019/10/11	2049/9/20	22,403.0	5,786.0	100.4000	0.3850%	17.7786%	100.4600	0.3820%	1,204.0
エネルギー対策	-	-	6,500	2019/10/21	2020/10/20	139,113.0	6,499.99		0.0000%	4.6726%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/10	2019/10/11	▲ 0.350	5	5		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年10月11日の予定

*9月のマネーストック	*米国10月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(863回)入札(3ヶ月、43,300億円、10/15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