

Central Daily Market Report

2019年10月11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11日		2019年10月15日		2019年10月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		500		1,000	
財政	▲ 8,100		81,400		2,000	
資金過不足	▲ 9,000		81,900		3,000	
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	▲ 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		▲ 400		▲ 500		
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	▲ 8,700		81,400		3,000	
当座預金残高	3,992,600		4,074,000		4,077,000	
準備預金残高	3,471,400					
積み終了先	3,471,300				10月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,471,300				積数	
非準備預金先	521,200				1日平均	
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	100.00%	日数	96.67%		

●2019年10月11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%での調達で始まった。積み最終日を直前に控えた取り調整の動きに加え、連休要因も重なったことでレート水準は高止まりした。一巡後も▲0.03~▲0.01%とほぼ横ばい圏で推移し、今週の取引を終えた。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(10/15-10/16)は、▲0.08~▲0.045%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、広いレンジで推移した。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▲0.320%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.3049%、按分落札利回▲0.2801%と前回債からレートが上昇する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.290%出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、6M物が▲0.290~▲0.284%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は閑散で、償還総額460億円程度に対して、発行総額は310億円程度と償還超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。本日はCP等買入オペアが、2,500億円オファーされた。平均落札レート0.004%、按分レート▲0.001%と、前回比(平均▲0.001%、按分▲0.005%)で共に上昇した。

●短期金融市場関連指標

2019/10/11	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.054	▲ 0.185	0.030	21,798.87	246.89	107.87-88	107.91-92
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.082						
2W			0.000				-	▲ 0.083						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.290	▲ 0.168						
6M							▲ 0.286	▲ 0.181						
1Y							▲ 0.296	▲ 0.196						
									日付	10/4	10/7	10/8	10/9	10/10
									日銀当預残	3,995,400	4,005,200	4,010,900	4,009,000	4,001,300
									準備預金残	3,502,400	3,485,800	3,493,800	3,499,500	3,483,500
									マネタリーベース	5,114,300	5,123,200	5,128,500	5,126,100	5,119,600
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.012%	▲0.012%	▲0.012%	▲0.011%
									コール市場残高	107,610	95,441	102,259	96,928	97,511
									うち無担	87,025	75,741	82,323	78,791	79,320
									うちO/N	63,065	52,766	59,673	56,011	56,495
									うち有担	20,585	19,700	19,936	18,137	18,191

●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	863	-	43,300	2019/10/15	2020/1/20	118,943.0	35,635.7	100.0745	▲0.2801%	52.5352%	100.0811	▲0.3049%	7,664.0

●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	2019/10/15	2019/10/28		2,168	2,168				
CP等買入	2,500	2019/10/17			8,099	2,485	▲0.001		0.004	17.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/11	2019/10/15	▲ 0.350	0	0				

●2019年10月14日の予定

*体育の日

*米国祝日(Columbus Day)

●2019年10月15日の予定

*8月の第3次産業活動指数

*8月の石油等消費動態統計

◆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