

Central Daily Market Report

2019年10月15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15日		2019年10月16日		2019年10月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		500		0	
財政	84,500		1,300		1,000	
資金過不足	84,900		1,800		1,000	
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			12,400			
CP等買入		▲500		▲100	2,500	
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	▲100			100		
当預増減	84,300		14,900		3,500	
当座預金残高	4,076,900		4,091,800		4,095,300	
準備預金残高	3,566,000					
積み終了先	3,566,000					
超過準備	3,565,900				10月16日以降の残り所要積立額 積数 3,194,000	
非準備預金先	510,900				1日平均 103,000	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,194,000	
準備預金進捗率	実績		0.00%		日数 0.00%	

●2019年10月15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▲0.01~▲0.005%での調達で始まった。年金定時払いで大幅な資金余剰日であるものの、積みの着地に向けた調達ニーズが強く、先週末とほぼ同水準で推移した。一巡後は▲0.015~▲0.01%で出会いが散見され、今積み期の取引を終えた。ターム物の出会いはロール案件中心の取引であった。

<レポ市場>

GC T/N(10/16-10/17)は、▲0.10~▲0.09%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、新積み期に入り小幅低下。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.290%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、償還総額500億円程度に対して、発行総額は550億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

2019/10/15	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	▲0.050	0.001	▲0.009				-	▲0.076	▲0.175	0.010	22,207.21	408.34	108.38-40	108.35-36
T/N							-	▲0.093						
S/N							-	-						
1W							-	▲0.095						
2W	▲0.030	0.000	▲0.020				-	▲0.094						
3W			0.000				-	▲0.098						
1M							-	▲0.104						
3M							▲0.290	▲0.169						
6M							▲0.286	▲0.181						
1Y							▲0.296	▲0.196						
									日付	10/7	10/8	10/9	10/10	10/11
									日銀当預残	4,005,200	4,010,900	4,009,000	4,001,300	3,992,600
									準備預金残	3,485,800	3,493,800	3,499,500	3,483,500	3,471,400
									マネタリーベース	5,123,200	5,128,500	5,126,100	5,119,600	5,111,700
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.012%	▲0.012%	▲0.011%	▲0.010%
									コール市場残高	95,441	102,259	96,928	97,511	87,898
									うち無担	75,741	82,323	78,791	79,320	68,271
									うちO/N	52,766	59,673	56,011	56,495	45,601
									うち有担	19,700	19,936	18,137	18,191	19,627

●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	2019/10/16			15,344	4,205	0.008		0.009	14.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/10/16			10,665	3,400	0.005		0.006	30.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/10/16			6,107	3,507	0.002		0.004	68.9
国債買入(変動利付債)	1,000	2019/10/16			3,413	1,001	▲0.210		▲0.236	21.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/15	2019/10/16	-0.35	97	97		▲0.350	▲0.350	

●2019年10月16日の予定

*ページブック	*ユーロ圏9月の消費者物価指数改定値	*交付税特別会計借入
*米国9月の小売売上高	*英国9月の消費者物価指数	(10,500億円、10/25借入)
*米国8月の企業在庫		

◆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