

Central Daily Market Report

2019年10月16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16日		2019年10月17日		2019年10月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 2,700		0		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 2,200		▲ 900		▲ 12,000	
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	12,400					
CP等買入		▲ 100	2,500	▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					100	▲ 100
社債等買入						
E T F 買入	700		100			
国債補完供給		100				
当預増減	10,900		2,300		▲ 12,000	
当座預金残高	4,087,800		4,090,100		4,078,100	
準備預金残高	3,547,300					
積み終了先	1,717,100					
超過準備	938,900					
非準備預金先	540,500					
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	81.67%	日数	3.23%		

●2019年10月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み期間が切り替わった事で参加者の調達姿勢が一変し、前日対比でレートが低下した。立ち上がりは邦銀、証券業態の調達を中心に▲0.07~▲0.03%の出合い。一巡後は▲0.07~▲0.04%近辺で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(10/17-10/18)は、▲0.095~▲0.08%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、横ばい圏で推移した。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6M物が▲0.276~▲0.271%で出合う展開となる中、応札額が1兆610億円と前回の2倍を越え、平均落札利回較差+0.040%、全取落札利回較差+0.040%と在庫調整の売りから弱い結果となった。この他に、3M物が▲0.280%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2,600億円程度に対して、発行総額は1,300億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。

●短期金融市場関連指標

2019/10/16	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.094	▲ 0.165	0.010	22,472.92	265.71	108.80-81	108.64-65
T/N							-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.032				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.022				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.098						
1M	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.024				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.280	▲ 0.162						
6M							▲ 0.271	▲ 0.180						
1Y							▲ 0.295	▲ 0.195						
									日付	10/8	10/9	10/10	10/11	10/15
									日銀当預残	4,010,900	4,009,000	4,001,300	3,992,600	4,076,900
									準備預金残	3,493,800	3,499,500	3,483,500	3,471,400	3,566,000
									マネタリーベース	5,128,500	5,126,100	5,119,600	5,111,700	5,195,700
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.012%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.009%
									コール市場残高	102,259	96,928	97,511	87,898	93,505
									うち無担	82,323	78,791	79,320	68,271	73,689
									うちO/N	59,673	56,011	56,495	45,601	51,009
									うち有担	19,936	18,137	18,191	19,627	19,816

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/10/25	2020/4/24	292,058.0	10,500.12		0.0000%	3.5953%		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	2019/10/17			10,610	1,000		0.040	0.040	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/16	2019/10/17	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/10/18	2019/10/25	2.340	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第102回	2019/10/18	2020/10/16	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第41回	2019/10/18	2020/10/16	0

●2019年10月17日の予定

*米国9月の住宅着工件数	*国庫短期証券(864回)入札 (1年、19,000億円、10/21発行)
*米国9月の鉱工業生産・設備稼働率	*5年利付国債入札 (19,000億円、10/18発行)

◆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