# Central Daily Market Report

2019年10月17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17日 需給速報 | | 2019年10月18日 需給予想 | | 2019年10月21日 当社予想 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 銀行券 | ▲ 1,000 | | ▲ 1,200 | | 0 | |
| 財政 | 300 | | ▲ 10,900 | | ▲ 2,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 700 | | ▲ 12,100 | | ▲ 2,000 | |
| 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 | | | | | | ▲ 1,600 |
| 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 | 2,500 | ▲ 400 | | ▲ 200 | | |
| 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 | | | | ▲ 100 | | |
| ＥＴＦ買入 | 100 | | 1,200 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 300 | | | 300 | | |
| 当預増減 | 2,200 | | ▲ 10,900 | | ▲ 3,600 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 4,090,000 | 4,079,100 | 4,075,500 |
| 準備預金残高 | 3,570,300 | | |
| 積み終了先 | 3,485,100 | | |
| 超過準備 | 3,102,200 | | |
| 非準備預金先 | 519,700 | | |

| 10月18日以降の残り所要積立額 | |
|---|---|
| 積数 | 117,500 |
| 1日平均 | 4,100 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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 | 96.32% | 日数 6.45% |

## ●2019年10月17日の市場動向

**<インターバンク市場>**

本日の無担O/N物は、複数の業態からやや強めの資金調達ニーズが示されたため、昨日より高めのレートでの取引が中心となった。立ち上がりは邦銀、証券業態の調達を中心に▲0.055～▲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(10/18-10/21)は、▲0.08～▲0.07%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、発行要因もあってか小幅上昇。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.195～▲0.190%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1936%、按分落札利回▲0.1876%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、▲0.209～▲0.195%出合いと堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.261%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、卸売業態で大型発行があり、償還総額500億円程度に対して、発行総額は2,200億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

| 2019/10/17 | 無担（速報） | | | 有担（速報） | | | 短国 | 東京レポレート |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 単位：% | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | 平均 | 売買参考統計値 | 平均値 |
| O/N | ▲ 0.070 | 0.001 | ▲ 0.045 | | | | － | ▲ 0.083 |
| T/N | | | | | | | － | ▲ 0.077 |
| S/N | | | | | | | － | － |
| 1W | | | ▲ 0.035 | | | | － | ▲ 0.078 |
| 2W | ▲ 0.028 | ▲ 0.010 | ▲ 0.024 | | | | － | ▲ 0.083 |
| 3W | | | ▲ 0.015 | | | | － | ▲ 0.089 |
| 1M | ▲ 0.030 | ▲ 0.025 | ▲ 0.026 | | | | － | ▲ 0.095 |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.280 | ▲ 0.159 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.261 | ▲ 0.179 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.204 | ▲ 0.194 |

| JGB新発10年債 | | 日経平均株価 | | ドル/円 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 | 為替（9時） | 為替（17時） |
| ▲ 0.160 | 0.005 | 22,451.86 | ▲ 21.06 | 108.67-68 | 108.83-84 |

| 日付 | 10/9 | 10/10 | 10/11 | 10/15 | 10/16 |
|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 4,009,000 | 4,001,300 | 3,992,600 | 4,076,900 | 4,087,800 |
| 準備預金残 | 3,499,500 | 3,483,500 | 3,471,400 | 3,566,000 | 3,547,300 |
| マネタリーベース | 5,126,100 | 5,119,600 | 5,111,700 | 5,195,700 | 5,206,100 |
| 無担O/N加重平均 | ▲0.012% | ▲0.011% | ▲0.010% | ▲0.009% | ▲0.051% |
| コール市場残高 | 96,928 | 97,511 | 87,898 | 93,505 | 99,778 |
| うち無担 | 78,791 | 79,320 | 68,271 | 73,689 | 80,007 |
| うちO/N | 56,011 | 56,495 | 45,601 | 51,009 | 58,112 |
| うち有担 | 18,137 | 18,191 | 19,627 | 19,816 | 19,771 |

## ●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Ｉ非価格競争入札(億円) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国庫短期証券 | 864 | － | 19,000 | 2019/10/21 | 2020/10/20 | 66,876.0 | 15,613.7 | 100.1880 | ▲0.1876% | 94.6938% | 100.1940 | ▲0.1936% | 3,386.0 |
| 5年利付国債 | 141 | 0.10% | 19,000 | 2019/10/18 | 2024/9/20 | 58,363.0 | 15,796.00 | 101.8700 | ▲0.2740% | 45.4644% | 101.9000 | ▲0.2800% | 3,196.0 |

## ●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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 社債等買入 | 1,250 | 2019/10/24 | | | 2,381 | 1,251 | ▲0.048 | | ▲0.040 | 87.5 |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分） | | 2019/10/17 | 2019/10/18 | ▲ 0.350 | 296 | 296 | | ▲0.350 | ▲0.350 | |

## ●2019年10月18日の予定

*月例経済報告
*9月の全国消費者物価指数（CPI）
市場予想：前年同月比（除く生鮮）＋0.3%

*国庫短期証券（865回）入札
（3ヶ月、42,700億円、10/21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。
◆本資料は何ら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論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