

Central Daily Market Report

2019年10月21日(月)

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21日		2019年10月23日		2019年10月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 500		▲ 1,000	
財政	4,800		▲ 2,900		2,000	
資金過不足	4,500		▲ 3,400		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	3,600	▲ 1,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	1,600		11,800			
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					1,300	
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	7,900		8,400		2,300	
当座預金残高	4,087,100		4,095,500		4,097,800	
準備預金残高	3,576,900					
積み終了先	3,575,100					
超過準備	3,574,100				10月23日以降の残り所要積立額 積数 15,300	
非準備預金先	510,200				1日平均 600	
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 99.52%		日数		22.58%	

●2019年10月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、先週に引き続き積極的な資金調達が見られた。邦銀勢に加え、18日に調達を控えていた証券業態からのビッドも復活し、より一層高い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▲0.02~▲0.015%の出会い。一巡後は▲0.04~▲0.02%のレンジで出会いが見られた。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>

GCT/N(10/23-10/24)は、▲0.07~▲0.05%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2Y402~405、10Y335~356、5Y136~141、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。アウトライト市場は、店頭での買いもあつてか1Y物が▲0.229~▲0.224%で出合った。また、引け際に3M物が▲0.210%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、医薬品・石油業態でまとまった発行があり、償還総額100億円程度に対して、発行総額は1,100億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

2019/10/21	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.077	▲ 0.140	0.015	22,548.90	56.22	108.40-42	108.56-57
T/N							-	▲ 0.062						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.066						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.070						
3W			0.000				-	▲ 0.077						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.084						
3M							▲ 0.210	▲ 0.147						
6M							▲ 0.250	▲ 0.175						
1Y							▲ 0.228	▲ 0.192						
									日付	10/11	10/15	10/16	10/17	10/18
									日銀当預残	3,992,600	4,076,900	4,087,800	4,090,000	4,079,200
									準備預金残	3,471,400	3,566,000	3,547,300	3,570,300	3,564,700
									マネタリーベース	5,111,700	5,195,700	5,206,100	5,209,200	5,199,700
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.009%	▲0.051%	▲0.045%	▲0.031%
									コール市場残高	87,898	93,505	99,778	100,115	97,201
									うち無担	68,271	73,689	80,007	80,142	76,289
									うちO/N	45,601	51,009	58,112	58,687	52,684
									うち有担	19,627	19,816	19,771	19,973	20,912

●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年以下)	500	2019/10/23			2,271	501	0.020		0.023	87.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/10/23			9,859	4,204	0.002		0.004	43.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/10/23			5,923	3,402	▲0.004		▲0.001	63.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/10/23			9,018	3,507	0.010		0.011	57.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/21	2019/10/23	▲0.350	58	58		▲0.350	▲0.350	

●2019年10月22日の予定

*即位礼正殿の儀	*米国9月の中古住宅販売
----------	--------------

●2019年10月23日の予定

特にありません。

◆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