

# Central Daily Market Report

2019年10月23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23日		2019年10月24日		2019年10月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,200		▲ 1,000	
財政	▲ 6,000		▲ 1,800		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 6,500		▲ 3,000		▲ 9,000	
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	11,800					
CP等買入		▲ 100		▲ 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			600			
国債補完供給		100				
当預増減	5,300		▲ 200		▲ 9,000	
当座預金残高	4,092,400		4,092,200		4,083,200	
準備預金残高	3,571,600					
積み終了先	3,570,400				10月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,570,200				積数 13,900	
非準備預金先	520,800				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 99.56%		日数 25.81%			

## ●2019年10月23日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き複数の業態から積極的な資金調達が見られ、高めのレートでの取引となった。立ち上がりは邦銀・証券業態の調達を中心に▲0.02~▲0.01%の出合い。一巡後は▲0.035~▲0.02%のレンジで出合いが見られた。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>

GC T/N(10/24-10/25)は、▲0.07~▲0.06%程度での出合い。SCはローラー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、小幅低下した。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▲0.240~▲0.225%で出合う展開となる中、平均落札利回較差+0.043%、按分落札利回較差+0.042%と在庫調整の売りから弱い結果となった。一方、マーケットでは3M物が▲0.220~▲0.210%出合いと堅調に推移していた。また、引け際に1Y物が▲0.233%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、5・10日発行にあたり、償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は1,400億円程度と発行超のマーケットとなった。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

2019/10/23	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.077	▲ 0.142	▲ 0.002	22,625.38	76.48	108.48-49	108.37-38
T/N							-	▲ 0.070						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.230	▲ 0.003				-	▲ 0.069						
2W	▲ 0.020	▲ 0.012	▲ 0.019				-	▲ 0.073						
3W							-	▲ 0.079						
1M							-	▲ 0.087						
3M	▲ 0.030	0.060	0.030				▲ 0.220	▲ 0.143						
6M							▲ 0.235	▲ 0.175						
1Y							▲ 0.233	▲ 0.192						
									日付	10/15	10/16	10/17	10/18	10/21
									日銀当預残	4,076,900	4,087,800	4,090,000	4,079,200	4,087,100
									準備預金残	3,566,000	3,547,300	3,570,300	3,564,700	3,576,900
									マネタリーベース	5,195,700	5,206,100	5,209,200	5,199,700	5,207,800
									無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.051%	▲0.045%	▲0.031%	▲0.019%
									コール市場残高	93,505	99,778	100,115	97,201	95,684
									うち無担	73,689	80,007	80,142	76,289	76,227
									うちO/N	51,009	58,112	58,687	52,684	52,242
									うち有担	19,816	19,771	19,973	20,912	19,457

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2019/10/24			7,051	1,000	0.042		0.043	90.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/23	2019/10/24	▲ 0.350	36	36		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/10/25	2019/10/31	2.380	0	0				

## ●2019年10月24日の予定

*8月の景気動向指数改訂状況	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*20年利付国債入札(9,000億円、10/25発行)
	*米国9月の新築一戸建て販売件数	
	*米国9月の耐久財新規受注	

◆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