

Central Daily Market Report

2019年10月24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24日		2019年10月25日		2019年10月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 300		0	
財政	▲ 2,900		▲ 3,700		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 3,900		▲ 4,000		▲ 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
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		▲ 100		▲ 400		
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			▲ 200		
E T F 買入	600		600			
国債補完供給						
当預増減	▲ 1,100		▲ 4,000		▲ 3,200	
当座預金残高	4,091,300		4,087,300		4,084,100	
準備預金残高	3,564,100					
積み終了先	3,563,000				10月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,563,000				積数 12,900	
非準備預金先	527,200				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 99.60%		日数 29.03%			

●2019年10月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地合いに特段の変化は見られず、引き続き複数の業態から積極的な資金調達が見られた。立ち上がりは邦銀・証券業態の調達を中心に▲0.03~▲0.005%の出合い。一巡後は、ビッド数がやや減少したものの、▲0.03~▲0.01%での出合いが散見された。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(10/25-10/28)は、▲0.075~▲0.055%程度での出合い。SCI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、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.226~▲0.224%、6M物が▲0.240%、1Y物が▲0.230%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600億円程度に対して、発行総額は500億円程度にとどまり、償還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

2019/10/24	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.075	▲ 0.150	▲ 0.008	22,750.60	125.22	108.63-64	108.69-71
T/N							-	▲ 0.071						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.072						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.075						
3W			0.000				-	▲ 0.079						
1M							-	▲ 0.087						
3M							▲ 0.224	▲ 0.139						
6M							▲ 0.240	▲ 0.175						
1Y							▲ 0.230	▲ 0.192						
									日付	10/16	10/17	10/18	10/21	10/23
									日銀当預残	4,087,800	4,090,000	4,079,200	4,087,100	4,092,400
									準備預金残	3,547,300	3,570,300	3,564,700	3,576,900	3,571,600
									マネタリーベース	5,206,100	5,209,200	5,199,700	5,207,800	5,213,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.051%	▲ 0.045%	▲ 0.031%	▲ 0.019%	▲ 0.014%
									コール市場残高	99,778	100,115	97,201	95,684	93,692
									うち無担	80,007	80,142	76,289	76,227	74,424
									うちO/N	58,112	58,687	52,684	52,242	50,854
									うち有担	19,771	19,973	20,912	19,457	19,268

●入札結果

名称	回数	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1非価格競争入札(億円)
20年利付国債	170	0.30%	9,000	2019/10/25	2039/9/20	28,717.0	7,352.00	100.9500	0.2490%	57.2532%	101.0400	0.2450%	1,641.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/24	2019/10/25	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年10月25日の予定

*国庫短期証券(866回)入札 (3ヶ月、42,700億円、10/28発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、11/5発行)
---	---------------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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