

Central Daily Market Report

2019年10月25日(金)

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25日		2019年10月28日		2019年10月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		400		0	
財政	▲ 4,100		10,300		2,000	
資金過不足	▲ 4,400		10,700		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			3,900	▲ 2,200		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 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		▲ 200				
E T F 買入	600					
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	▲ 4,600		12,600		2,000	
当座預金残高	4,086,700		4,099,300		4,101,300	
準備預金残高	3,560,500					
積み終了先	3,559,200					
超過準備	3,559,100				10月28日以降の残り所要積立額 積数 8,900	
非準備預金先	526,200				1日平均 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		99.72%		日数 38.71%	

●2019年10月25日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因もあり引き続き調達ニーズの強い展開となった。朝方は、邦銀・証券業態を中心に▲0.02~▲0.005%での調達。しかし一巡後は、ビッド水準が▲0.035~▲0.015%に低下し、散発的な出会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(10/28-10/29)は、▲0.060~▲0.050%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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.215~▲0.195%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.1943%、按分落札利回▲0.1712%とテールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.200~▲0.180%出会いと堅調に推移した。この他に、6M物と1Y物が▲0.225%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、卸売業態でまとまった発行があったものの、発行総額400億円程度に対して、償還総額は900億円程度と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

2019/10/25	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	▲ 0.014				-	▲ 0.065	▲ 0.150	0.000	22,799.81	49.21	108.60-62	108.61-62
T/N							-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.066						
2W			▲ 0.013				-	▲ 0.067						
3W	▲ 0.015	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.076						
1M							-	▲ 0.083						
3M			0.000				▲ 0.200	▲ 0.134						
6M							▲ 0.235	▲ 0.175						
1Y							▲ 0.225	▲ 0.192						
									日付	10/17	10/18	10/21	10/23	10/24
									日銀当預残	4,090,000	4,079,200	4,087,100	4,092,400	4,091,300
									準備預金残	3,570,300	3,564,700	3,576,900	3,571,600	3,564,100
									マネタリーベース	5,209,200	5,199,700	5,207,800	5,213,600	5,213,600
									無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.031%	▲0.019%	▲0.014%	▲0.013%
									コール市場残高	100,115	97,201	95,684	93,692	94,039
									うち無担	80,142	76,289	76,227	74,424	74,946
									うちO/N	58,687	52,684	52,242	50,854	50,816
									うち有担	19,973	20,912	19,457	19,268	19,093

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	866	-	42,700	2019/10/28	2020/2/3	101,809.0	34,854.8	100.0460	▲0.1712%	86.1718%	100.0522	▲0.1943%	7,845.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/11/5	2020/5/7	312,271.0	10,500.28		0.0000%	3.3626%		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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	15,000	2019/10/28	2019/11/11		3,918	3,918				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/25	2019/10/28	▲ 0.350	199	199		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/10/25	2019/10/28	▲ 0.350	10	10		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年10月28日の予定

*9月の企業向けサービス価格指数

◆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