

# Central Daily Market Report

2019年10月18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18日		2019年10月21日		2019年10月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		0		▲ 1,000	
財政	▲ 10,700		2,400		2,000	
資金過不足	▲ 11,900		2,400		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			
CP等買入		▲ 200		▲ 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				
E T F 買入	1,200					
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当預増減	▲ 10,800		5,900		1,000	
当座預金残高	4,079,200		4,085,100		4,086,100	
準備預金残高	3,564,700					
積み終了先	3,560,800					
超過準備	3,532,500				10月21日以降の残り所要積立額 積数 20,900	
非準備預金先	514,500				1日平均 800	
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		99.35%		日数 16.13%	

## ●2019年10月18日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、証券業態からの資金調達が減る一方、邦銀勢からは積極的な資金調達が見られ、昨日よりレートが上昇した。立ち上がりは邦銀の調達を中心に▲0.04~▲0.025%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(10/21-10/22)は、▲0.07~▲0.05%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2Y402~405、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、短国の発行要因もあってか小幅上昇。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▲0.270~▲0.250%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.2385%、按分落札利回▲0.1991%とテールが大きく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も、▲0.210~▲0.190%出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、6M物が▲0.250%、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、小売、ノンバンク業態で大型発行があり、償還総額600億円程度に対して、発行総額は1,400億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

2019/10/18	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	▲ 0.031				-	▲ 0.069	▲ 0.155	0.005	22,492.68	40.82	108.59-60	108.64-65
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.064						
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.024				-	▲ 0.070						
3W							-	▲ 0.076						
1M	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.020				-	▲ 0.086						
3M							▲ 0.210	▲ 0.149						
6M							▲ 0.250	▲ 0.176						
1Y							▲ 0.220	▲ 0.190						
									日付	10/10	10/11	10/15	10/16	10/17
									日銀当預残	4,001,300	3,992,600	4,076,900	4,087,800	4,090,000
									準備預金残	3,483,500	3,471,400	3,566,000	3,547,300	3,570,300
									マネタリーベース	5,119,600	5,111,700	5,195,700	5,206,100	5,209,200
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.010%	▲0.009%	▲0.051%	▲0.045%
									コール市場残高	97,511	87,898	93,505	99,778	100,115
									うち無担	79,320	68,271	73,689	80,007	80,142
									うちO/N	56,495	45,601	51,009	58,112	58,687
									うち有担	18,191	19,627	19,816	19,771	19,973

## ●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)	募入最低値	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	865	-	42,700	2019/10/21	2020/1/27	101,766.0	34,958.8	100.0535	▲0.1991%	59.2834%	100.0641	▲0.2385%	7,741.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/10/21	2019/11/5		3,598	3,598				
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2019/10/21			3,845	1,211	0.008		0.009	54.3
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/10/21			1,059	303	0.009		0.010	81.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/18	2019/10/21	▲ 0.350	52	52		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年10月21日の予定

\*9月の貿易統計

◆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