

Central Daily Market Report

2019年9月30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9月30日 | | 2019年10月1日 | | 2019年10月2日 | |
|------------------------|------------|---------|------------|--------|-----------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 400 | | 700 | | 1,000 | |
| 財政 | ▲ 2,000 | | ▲ 25,300 | | ▲ 52,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 1,600 | | ▲ 24,600 | | ▲ 51,000 | |
| 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 | ▲ 2,200 | | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | | | 7,800 | | | |
| CP等買入 | 4,000 | ▲ 4,400 | | | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| E T F 買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 1,100 | 400 | | 1,100 | | |
| 当預増減 | ▲ 2,700 | | ▲ 15,700 | | ▲ 51,000 | |
| 当座預金残高 | 4,084,100 | | 4,068,400 | | 4,017,400 | |
| 準備預金残高 | 3,553,400 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,551,600 | | | | 10月1日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,549,200 | | | | 積数 | |
| 非準備預金先 | 530,700 | | | | 1日平均 | |
| 積み期間(9/16~10/15)の所要準備額 | | | | | 3,085,600 | |
| 準備預金進捗率 | 実績 | 99.87% | 日数 | 50.00% | | |

●2019年9月30日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀・証券を中心に▲0.080~▲0.025%のレンジでの取引となった。四半期末要因から参加者が減少し、▲0.070%で寄り付き後は、散発的な出合いが散見された。出合い一巡後は目途つけた参加者が多かったことから閑散となり、午後に▲0.025%の出合いが見られた程度であった。ターム物に関しては特段目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(10/1-10/2)は、▲0.105~▲0.09%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2Y402~404、10Y335~355、5Y136~140、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、小幅上昇。アウトライト市場は、店頭での買いもあってか、3M物が▲0.390~▲0.370%、6M物が▲0.315~▲0.305%、1Y物が▲0.311~▲0.305%で散発的に出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還が無かったものの発行総額は2,000億円程度まで膨らんだ。卸売・石油業態において大型発行が見られ、案件は多くなかったが月初旬の発行としてはやや活況なマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

| 2019/9/30 | 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 | 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 | 為替(9時) |
| O/N | ▲ 0.086 | 0.001 | ▲ 0.064 | | | | - | ▲ 0.116 | ▲ 0.225 | 0.015 | 21,755.84 | ▲ 123.06 | 107.94-96 | 107.85-87 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.099 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | | | ▲ 0.035 | | | | - | ▲ 0.102 | | | | | | |
| 2W | | | ▲ 0.060 | | | | - | ▲ 0.104 | | | | | | |
| 3W | | | 0.001 | | | | - | ▲ 0.107 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.110 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.391 | ▲ 0.154 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.315 | ▲ 0.172 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.306 | ▲ 0.187 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 9/20 | 9/24 | 9/25 | 9/26 | 9/27 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 4,095,600 | 4,095,900 | 4,101,000 | 4,097,600 | 4,086,800 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,569,200 | 3,579,900 | 3,563,000 | 3,562,500 | 3,550,400 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 5,215,300 | 5,215,200 | 5,219,900 | 5,217,800 | 5,207,800 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.057% | ▲ 0.059% | ▲ 0.058% | ▲ 0.055% | ▲ 0.046% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 122,164 | 115,038 | 113,186 | 116,227 | 109,914 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 101,125 | 92,020 | 91,954 | 95,092 | 88,919 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 69,210 | 61,715 | 60,939 | 63,657 | 59,374 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 21,039 | 23,018 | 21,232 | 21,135 | 20,995 |

●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 | 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年超3年以下) | 4,200 | 2019/10/1 | | | 13,723 | 4,204 | 0.005 | | 0.007 | 2.6 |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下) | 3,400 | 2019/10/1 | | | 7,242 | 3,403 | 0.001 | | 0.002 | 76.2 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2019/9/30 | 2019/10/1 | ▲ 0.350 | 1,043 | 1,043 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2019/9/30 | 2019/10/1 | ▲ 0.350 | 2 | 2 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |

●2019年10月1日の予定

| | | |
|----------------------------|--------------------|-------------------|
| *8月の完全失業率(市場予想:2.3%) | *米国8月の建設支出 | *10年利付国債入札 |
| *8月の有効求人倍率(市場予想:1.58倍) | *米国9月のISM製造業景況指数 | (21,000億円、10/2発行) |
| *9月調査の日銀短観(概要及び要旨) | *ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値 | |
| 市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI):+2 | | |

◆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