Central Daily Market Report

2019年10月1日（火）
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1日 需給速報		2019年10月2日 需給予想		2019年10月3日 当社予想	
銀行券	700		500		0	
財政	▲ 26,400		▲ 68,300		2,000	
資金過不足	▲ 25,700		▲ 67,800		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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	7,800					
CP等買入				▲ 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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給		1,100				
当預増減	▲ 16,800		▲ 66,900		2,000	

当座預金残高	4,067,300	4,000,400	4,002,400
準備預金残高	3,540,200		
積み終了先	3,539,800	10月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,539,800	積数	3,600
非準備預金先	527,100	1日平均	300
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 99.88%	日数	53.33%

●2019年10月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.055～▲0.02%の出合いが中心となった。四半期末要因の剥落から資金調達サイドの参加者が増加した。一巡後は▲0.07～▲0.04%で調整の出合いが散見された。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.035～▲0.03%程度の出合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(10/2-10/3)は、▲0.090～▲0.075%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。アウトライト市場では、短国買入オペが1,000億円（前回比▲1,500億円）でオファーされた。平均落札利回較差+0.012%、按分落札利回較差+0.006%と在庫調整の売りからか弱めの結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.390%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額200億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と大きく、発行超となった。卸売業態において大型発行が見られ、案件は少なかったものの、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

2019/10/1	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.048				－	▲ 0.097
T/N							－	▲ 0.089
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.029				－	▲ 0.093
2W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.016				－	▲ 0.096
3W							－	▲ 0.102
1M	▲ 0.020	0.480	▲ 0.008				－	▲ 0.108
3M							▲ 0.390	▲ 0.164
6M							▲ 0.293	▲ 0.176
1Y							▲ 0.305	▲ 0.193

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.140	0.085	21,885.24	129.40	108.05-06	108.34-35

日付	9/24	9/25	9/26	9/27	9/30
日銀当預残	4,095,900	4,101,000	4,097,600	4,086,800	4,084,100
準備預金残	3,579,900	3,563,000	3,562,500	3,550,400	3,553,400
マネタリーベース	5,215,200	5,219,900	5,217,800	5,207,800	5,204,800
無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.058%	▲0.055%	▲0.046%	▲0.064%
コール市場残高	115,038	113,186	116,227	109,914	75,098
うち無担	92,020	91,954	95,092	88,919	60,524
うちO/N	61,715	60,939	63,657	59,374	45,044
うち有担	23,018	21,232	21,135	20,995	14,574

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
10年利付国債	356	0.10%	21,000	2019/10/2	2029/9/20	59,808.0	17,467.00	102.3300	▲0.1300%	6.1227%	102.6200	▲0.1580%	3,530.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2019/10/2			4,426	1,000	0.006		0.012	25.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2019/10/1	2019/10/2	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2019/10/3	2019/10/10	2.350	1	1				

●2019年10月2日の予定

*9月実績/10月見込み財政資金対民間収支
*9月のマネタリーベース
*9月の消費動向調査
*交付税特別会計借入
（10,500億円、10/11借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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