

Central Daily Market Report

2019年10月2日(水)
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2日		2019年10月3日		2019年10月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		▲ 200		0	
財政	▲ 68,500		1,100		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 67,900		900		▲ 3,000	
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						
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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	▲ 200			200		
当預増減	▲ 67,200		900		▲ 3,000	
当座預金残高	4,000,100		4,001,000		3,998,000	
準備預金残高	3,497,100					
積み終了先	3,496,600				10月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,496,600				積数 3,100	
非準備預金先	503,000				1日平均 200	
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	99.90%	日数	56.67%		

●2019年10月2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、証券業態を中心に▲0.04~▲0.02%での調達で始まった。税揚げ要因により不足日となったこともあり、昨日よりもやや調達レートが上昇した。一巡後は▲0.04%近辺での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(10/3-10/4)は、▲0.070~▲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、10Y335~355、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、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<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500億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と大きく発行超であった。卸売・その他金融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

2019/10/2	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.073	▲ 0.170	▲ 0.030	21,778.61	▲ 106.63	107.74-76	107.67-68
T/N			▲ 0.045				-	▲ 0.069						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.074						
2W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.019				-	▲ 0.078						
3W							-	▲ 0.088						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.390	▲ 0.169						
6M							▲ 0.293	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.306	▲ 0.198						
									日付	9/25	9/26	9/27	9/30	10/1
									日銀当預残	4,101,000	4,097,600	4,086,800	4,084,100	4,067,300
									準備預金残	3,563,000	3,562,500	3,550,400	3,553,400	3,540,000
									マネタリーベース	5,219,900	5,217,800	5,207,800	5,204,800	5,187,300
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.055%	▲0.046%	▲0.064%	▲0.048%
									コール市場残高	113,186	116,227	109,914	75,098	98,530
									うち無担	91,954	95,092	88,919	60,524	77,448
									うちO/N	60,939	63,657	59,374	45,044	56,643
									うち有担	21,232	21,135	20,995	14,574	21,082

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/10/11	2020/4/10	276,319.0	10,500.08		0.0000%	3.8000%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/2	2019/10/3	▲ 0.350	200	200		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/10/2	2019/10/3	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年10月3日の予定

*布野日銀審議委員、島根県金融経済懇談会において講演
*10月の日銀当座預金増減要因見込み

*米国9月のISM 非製造業景況指数
*米国8月の製造業新規受注・出荷・在庫
*流動性供給入札
(5,000億円、10/4発行)

◆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