

Central Daily Market Report

2019年10月3日(木)
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3日		2019年10月4日		2019年10月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		600		1,000	
財政	100		▲ 3,400		▲ 2,000	
資金過不足	0		▲ 2,800		▲ 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						▲ 3,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	▲ 200		▲ 2,600		▲ 4,100	
当座預金残高	3,999,900		3,997,300		3,993,200	
準備預金残高	3,485,500					
積み終了先	3,484,900					
超過準備	3,484,900					
非準備預金先	514,400					
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	99.92%	日数	60.00%		

●2019年10月3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▲0.025~▲0.01%近辺の出合いが中心となった。昨日の高止まりもあり、レートを一段と切り上げての出合いとなった。一巡後は▲0.03~▲0.02%前後で散発的な出合いが見られた程度であった。ターム物に関してはショートターム物を中心に、O/N物レートの上昇に伴い、前日よりも切り上げたレートでの出合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(10/4-10/7)は、▲0.06~▲0.045%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、上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.380%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1,000億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と発行超であった。機械・建設業態において大型発行が見られ、案件は少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

2019/10/3	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	▲ 0.019				-	▲ 0.052	▲ 0.195	▲ 0.025	21,341.74	▲ 436.87	107.16-18	107.22-24
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.049						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.057						
2W							-	▲ 0.066						
3W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.076						
1M							-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.380	▲ 0.165						
6M							▲ 0.293	▲ 0.185						
1Y							▲ 0.306	▲ 0.201						
									日付	9/26	9/27	9/30	10/1	10/2
									日銀当預残	4,097,600	4,086,800	4,084,100	4,067,300	4,000,100
									準備預金残	3,562,500	3,550,400	3,553,400	3,540,000	3,497,200
									マネタリーベース	5,217,800	5,207,800	5,204,800	5,187,300	5,119,500
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.046%	▲0.064%	▲0.048%	▲0.036%
									コール市場残高	116,227	109,914	75,098	98,530	100,175
									うち無担	95,092	88,919	60,524	77,448	78,799
									うちO/N	63,657	59,374	45,044	56,643	58,194
									うち有担	21,135	20,995	14,574	21,082	21,376

●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)
流動性供給	295	-	5,000	2019/10/4		13,784.0	4,992.0		0.0010%	79.7583%		▲0.0020%	

●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)		2019/10/3	2019/10/4	▲0.350	188	188		▲0.350	▲0.350	

●2019年10月4日の予定

*米国8月の貿易収支
*米国9月の雇用統計

*国庫短期証券(861回)入札
(3ヶ月、42,700億円、10/7発行)

◆本資料は信頼できるとさ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ことがあります。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