

Central Daily Market Report

2019年10月28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10月28日		2019年10月29日		2019年10月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 200		▲ 1,000	
財政	13,500		▲ 6,100		▲ 1,000	
資金過不足	13,800		▲ 6,300		▲ 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	3,900	▲ 2,200				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,700			
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						
E T F 買入			100			
国債補完供給		200				
当預増減	15,700		5,400		▲ 2,000	
当座預金残高	4,102,400		4,107,800		4,105,800	
準備預金残高	3,588,000					
積み終了先	3,586,200					
超過準備	3,586,200					
非準備預金先	514,400					
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	99.78%	日数	41.94%		

●2019年10月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、参加者の資金調達ニーズに大きな変化は見られず、先週に引き続き高めのレートでの取引となった。立ち上がりは邦銀・証券業態の調達を中心に▲0.02~▲0.01%の出合い。一巡後はビッドの数が減少したためレートがやや切り下がり、▲0.03~▲0.02%のレンジで出合いとなった。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(10/29-10/30)は、▲0.065~▲0.055%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、10Y336~356、5Y136~141、20Y167~169、30Y59~63、40Y9~12等にビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.200%、1Y物が▲0.225%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、食料品、不動産業態で大ロットの発行が見られ、発行総額は2,000億円程度と、償還総額の1,000億円程度を上回った。発行レートは引き続き0%近辺で推移している。本日はCP等買入オペアが2,500億円オファーされた。結果は平均落札レート0%、按分落札レート▲0.001%と、前回(平均0.004%、按分▲0.001%)比で平均レートは低下、按分レートは横ばいとなった。

●短期金融市場関連指標

2019/10/28	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.063	▲ 0.135	0.015	22,867.27	67.46	108.74-75	108.73-74
T/N							-	▲ 0.057						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.060						
2W			▲ 0.018				-	▲ 0.062						
3W							-	▲ 0.071						
1M							-	▲ 0.079						
3M	▲ 0.030	0.000	▲ 0.026				▲ 0.200	▲ 0.129						
6M			0.040				▲ 0.235	▲ 0.173						
1Y							▲ 0.225	▲ 0.192						
									日付	10/18	10/21	10/23	10/24	10/25
									日銀当預残	4,079,200	4,087,100	4,092,400	4,091,300	4,086,700
									準備預金残	3,564,700	3,576,900	3,571,600	3,564,100	3,560,500
									マネタリーベース	5,199,700	5,207,800	5,213,600	5,213,600	5,209,400
									無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.019%	▲0.014%	▲0.013%	▲0.014%
									コール市場残高	97,201	95,684	93,692	94,039	96,728
									うち無担	76,289	76,227	74,424	74,946	77,374
									うちO/N	52,684	52,242	50,854	50,816	53,524
									うち有担	20,912	19,457	19,268	19,093	19,354

●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	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	応募総額(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	2019/10/29			9,648	4,212	0.018		0.019	94.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/10/29			7,858	3,406	0.014		0.016	18.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/10/29			7,791	3,514	0.013		0.015	43.0
国債買入(物価連動債)	250	2019/10/29			1,016	251	0.050		▲0.060	26.7
CP等買入	2500	2019/10/31			8,905	2,495	▲0.001		0.000	20.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/28	2019/10/29	▲ 0.350		1		▲0.350	▲0.350	

●2019年10月29日の予定

*10月の都区部消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.7%	*米国FOMC(1日目) *米国8月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 *米国10月のCB消費者信頼感指数	*2年利付国債入札 (20,000億円、11/1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