

Central Daily Market Report

2019年10月29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29日		2019年10月30日		2019年10月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 300		▲ 1,000	
財政	▲ 4,600		1,100		▲ 600	
資金過不足	▲ 4,900		800		▲ 1,600	
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	11,700					
CP等買入		▲ 100	▲ 100		2,500	
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	▲ 100		100			
当預増減	6,700		1,800		900	
当座預金残高	4,109,100		4,110,900		4,111,800	
準備預金残高	3,578,200					
積み終了先	3,576,800					
超過準備	3,576,700				10月30日以降の残り所要積立額 積数 5,700 1日平均 300	
非準備預金先	530,900					
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	99.82%	日数	45.16%		

●2019年10月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き各業態から積極的な資金調達が見られた。しかし、一部で調達水準を引き下げる動きも見られた事で、取引レートは昨日対比で若干低下した。立ち上がりは邦銀・証券業態の調達を中心に▲0.025~▲0.015%の出合い。一巡後は▲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(10/30-10/31)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。アウトライト市場では、短国買入オペが1,000億円(前回と同額)でオファーされた。平均落札利回較差+0.047%、按分落札利回較差+0.035%と在庫調整の売りから弱い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.200%で、引け際には1Y物が▲0.220%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。発行市場は月末発行にあたり、鉄鋼、機械、ゴム製品、石油・石炭など複数業態でまとまった量の調達が行われ、発行総額は7,800億円程度まで膨らんだが、償還総額8,400億円程度を下回った。発行レートに特段の変化は見られず、0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/10/29	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.072	▲ 0.113	0.022	22,974.13	106.86	108.97-98	108.85-86
T/N							-	▲ 0.059						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.005	▲ 0.018				-	▲ 0.062						
2W							-	▲ 0.065						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.071						
1M							-	▲ 0.078						
3M							▲ 0.200	▲ 0.128						
6M							▲ 0.230	▲ 0.173						
1Y							▲ 0.220	▲ 0.192						
									日付	10/21	10/23	10/24	10/25	10/28
									日銀当預残	4,087,100	4,092,400	4,091,300	4,086,700	4,102,400
									準備預金残	3,576,900	3,571,600	3,564,100	3,560,500	3,588,400
									マネタリーベース	5,207,800	5,213,600	5,213,600	5,209,400	5,224,700
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.014%	▲0.013%	▲0.014%	▲0.016%
									コール市場残高	95,684	93,692	94,039	96,728	94,647
									うち無担	76,227	74,424	74,946	77,374	75,521
									うちO/N	52,242	50,854	50,816	53,524	50,486
									うち有担	19,457	19,268	19,093	19,354	19,126

●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)
2年利付国債	406	0.10%	20,000	2019/11/1	2021/11/1	78,814.0	16,382.0	100.6200	▲0.2080%	82.9210%	100.6200	▲0.2080%	3,612.0

●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	2019/10/30			5,780	1,000	0.035		0.047	7.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/29	2019/10/30	▲ 0.350	84	84		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/10/31	2019/11/7	2.140	0	0				

●2019年10月30日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、31日まで)	*米国FOMC(2日目)	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/8借入)
*9月の商業動態統計速報	*米国7-9月期のGDP速報値	

◆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お客様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