

Central Daily Market Report

2019年11月1日(金)
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11月1日		2019年11月5日		2019年11月6日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 800	500				1,000
財政	▲ 28,800	▲ 5,900				2,000
資金過不足	▲ 29,600	▲ 5,400				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			1,700	▲ 3,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,100			
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						
国債補完供給						
当預増減	▲ 29,600	▲ 3,300				3,000
当座預金残高	4,076,500	4,073,200	4,076,200			
準備預金残高	3,533,800					
積み終了先	3,533,300					
超過準備	3,533,300				11月5日以降の残り所要積立額 積数 2,300	
非準備預金先	542,700				1日平均 200	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額						3,193,600
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	64.52%		

●2019年11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・証券業態の調達を中心となった。月末要因が剥落し、4日積みにより取り上がる動きも散見され、朝方は▲0.03~▲0.015%の出合い。一巡後は▲0.06~▲0.025%の出合いが見られた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(11/5-11/6)は、▲0.065~▲0.050%程度での出合い。SCはローラー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、20Y167~170、30Y59~64、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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.180~▲0.160%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1700%、按分落札利回▲0.1579%と、前回債からレートが上昇する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.174~▲0.170%出合いと堅調に推移した。また、債券相場全体が強含みだったこともあってか、1Y物が▲0.245~▲0.230%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行案件は2件のみと閑散だったが、鉄鋼業態が1,000億円程度と大ロットで調達したこと、償還総額300億円程度に対し、発行総額1,400億円程度と大幅発行超となった。発行レートについては、大型案件においても上昇圧力は観測されず、0%近辺の低い水準で決着している。

●短期金融市場関連指標

2019/11/1	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.064	▲ 0.185	▲ 0.040	22,850.77	▲ 76.27	108.00-01	107.95-97
T/N							-	▲ 0.059						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.061						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.029				-	▲ 0.063						
3W			0.000				-	▲ 0.072						
1M							-	▲ 0.080						
3M							▲ 0.175	▲ 0.125						
6M							▲ 0.240	▲ 0.170						
1Y							▲ 0.240	▲ 0.192						
									日付	10/25	10/28	10/29	10/30	10/31
									日銀当預残	4,086,700	4,102,400	4,109,100	4,108,300	4,106,100
									準備預金残	3,560,500	3,588,400	3,578,700	3,572,500	3,563,800
									マネタリーベース	5,209,400	5,224,700	5,231,700	5,231,300	5,230,300
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.016%	▲0.021%	▲0.024%	▲0.030%
									コール市場残高	96,728	94,647	96,753	97,659	94,239
									うち無担	77,374	75,521	77,200	77,828	74,425
									うちO/N	53,524	50,486	51,675	53,053	53,760
									うち有担	19,354	19,126	19,553	19,831	19,814

●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)
国庫短期証券	867	-	43,000	2019/11/5	2020/2/10	129,801.0	35,103.7	100.0420	▲0.1579%	90.0480%	100.0452	▲0.1700%	7,896.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/11/5	2019/11/11		1,723	1,723				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/11/5			9,211	3,504	▲0.047		▲0.044	25.9
国債買入(物価連動債)	300	2019/11/5			1,320	301	0.350		0.288	87.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/11/1	2019/11/5	▲0.350	0	0				

●2019年11月4日の予定

*振替休日	*米国9月の製造業新規受注・出荷・在庫
-------	---------------------

●2019年11月5日の予定

*10月実績/11月見込み財政資金対民間収支	*米国9月の貿易収支
*10月のマネタリーベース	*米国10月のISM非製造業景況指数

◆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