

Central Daily Market Report

2019年9月30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9月30日		2019年10月1日		2019年10月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		700		1,000	
財政	▲ 2,000		▲ 25,300		▲ 52,000	
資金過不足	▲ 1,600		▲ 24,600		▲ 51,000	
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	2,200	▲ 2,200				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,800			
CP等買入	4,000	▲ 4,400				
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	▲ 1,100	400		1,100		
当預増減	▲ 2,700		▲ 15,700		▲ 51,000	
当座預金残高	4,084,100		4,068,400		4,017,400	
準備預金残高	3,553,400					
積み終了先	3,551,600				10月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,549,200				積数	
非準備預金先	530,700				1日平均	
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	99.87%	日数	50.00%		

●2019年9月30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・証券を中心に▲0.080~▲0.025%のレンジでの取引となった。四半期末要因から参加者が減少し、▲0.070%で寄り付き後は、散発的な出合いが散見された。出合い一巡後は目途つけた参加者が多かったことから閑散となり、午後に▲0.025%の出合いが見られた程度であった。ターム物に関しては特段目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(10/1-10/2)は、▲0.105~▲0.09%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2Y402~404、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、店頭での買いもあってか、3M物が▲0.390~▲0.370%、6M物が▲0.315~▲0.305%、1Y物が▲0.311~▲0.305%で散発的に出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還が無かったものの発行総額は2,000億円程度まで膨らんだ。卸売・石油業態において大型発行が見られ、案件は多く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

2019/9/30	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.116	▲ 0.225	0.015	21,755.84	▲ 123.06	107.94-96	107.85-87
T/N							-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.102						
2W			▲ 0.060				-	▲ 0.104						
3W			0.001				-	▲ 0.107						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.391	▲ 0.154						
6M							▲ 0.315	▲ 0.172						
1Y							▲ 0.306	▲ 0.187						
									日付	9/20	9/24	9/25	9/26	9/27
									日銀当預残	4,095,600	4,095,900	4,101,000	4,097,600	4,086,800
									準備預金残	3,569,200	3,579,900	3,563,000	3,562,500	3,550,400
									マネタリーベース	5,215,300	5,215,200	5,219,900	5,217,800	5,207,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.057%	▲ 0.059%	▲ 0.058%	▲ 0.055%	▲ 0.046%
									コール市場残高	122,164	115,038	113,186	116,227	109,914
									うち無担	101,125	92,020	91,954	95,092	88,919
									うちO/N	69,210	61,715	60,939	63,657	59,374
									うち有担	21,039	23,018	21,232	21,135	20,995

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/10/1			13,723	4,204	0.005		0.007	2.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/10/1			7,242	3,403	0.001		0.002	76.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/30	2019/10/1	▲ 0.350	1,043	1,043		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/9/30	2019/10/1	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年10月1日の予定

*8月の完全失業率(市場予想:2.3%)	*米国8月の建設支出	*10年利付国債入札
*8月の有効求人倍率(市場予想:1.58倍)	*米国9月のISM製造業景況指数	(21,000億円、10/2発行)
*9月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値	
市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI):+2		

◆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