

Central Daily Market Report

2019年10月30日(水)

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30日		2019年10月31日		2019年11月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 1,000		▲ 1,000	
財政	▲ 1,300		▲ 400		▲ 27,000	
資金過不足	▲ 1,700		▲ 1,400		▲ 28,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			1,900			
CP等買入		▲ 100	2,500	▲ 1,300		
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			200			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 800		2,000		▲ 28,000	
当座預金残高	4,108,300		4,110,300		4,082,300	
準備預金残高	3,572,100					
積み終了先	3,571,400				10月31日以降の残り所要積立額	
超過準備					積数 4,900	
非準備預金先	536,200				1日平均 300	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,193,400	
準備預金進捗率	実績	99.85%	日数	48.39%		

●2019年10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、昨日より若干レートが低下した。調達サイドの参加者が積みの序盤に比べ減少し、徐々に調達レートを切り下げる先が出てきていることが影響した。立ち上がりは邦銀・証券業態の調達を中心に▲0.025~▲0.02%の出合い。一巡後は▲0.04~▲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(10/31-11/1)は、▲0.070~▲0.050%程度での出合い。朝方は、月末初取引となることからオファーの入りが慎重だったが、後場は今積み期の平均的な水準までレートを切り上げた。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、20Y167~170、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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.200~▲0.1975%、1Y物が▲0.220%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、石油・石炭業態で比較的多量に調達が行われ、発行総額は1,200億円程度と償還総額400億円程度を上回った。発行レートは引続き横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/10/30	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.073	▲ 0.125	▲ 0.012	22,843.12	▲ 131.01	108.87-89	108.85-86
T/N							-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.025				-	▲ 0.067						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.069						
3W							-	▲ 0.075						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.081						
3M							▲ 0.198	▲ 0.127						
6M							▲ 0.230	▲ 0.171						
1Y							▲ 0.220	▲ 0.192						
									日付	10/23	10/24	10/25	10/28	10/29
									日銀当預残	4,092,400	4,091,300	4,086,700	4,102,400	4,109,100
									準備預金残	3,571,600	3,564,100	3,560,500	3,588,400	3,578,700
									マネタリーベース	5,213,600	5,213,600	5,209,400	5,224,700	5,231,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.013%	▲ 0.014%	▲ 0.016%	▲ 0.021%
									コール市場残高	93,692	94,039	96,728	94,647	96,753
									うち無担	74,424	74,946	77,374	75,521	77,200
									うちO/N	50,854	50,816	53,524	50,486	51,675
									うち有担	19,268	19,093	19,354	19,126	19,553

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/11/8	2020/5/8	292,929.0	10,500.19		0.0000%	3.5846%		0.0000%	

●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10年超25年以下)	1,200	2019/10/31			4,524	1,204	▲0.018		▲0.016	27.9
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/10/31			924	302	▲0.020		▲0.018	52.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/10/30	2019/10/31	▲ 0.350	128	128		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年10月31日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*米国9月の個人所得・消費支出
*黒田日銀日銀総裁、定例会見	*米国10月のシカゴPM景況感指数
*経済・物価情勢の展望	*ユーロ圏10月の消費者物価指数速報値
*9月の住宅着工統計	*ユーロ圏7-9月期のGDP1次速報
*9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+0.4%)	

◆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