

Central Daily Market Report

2019年9月3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9月3日 需給速報	2019年9月4日 需給予想	2019年9月5日 当社予想
銀行券	600	600	0
財政	▲ 11,700	▲ 43,200	2,000
資金過不足	▲ 11,100	▲ 42,600	2,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		2,500	
国債買入	2,100		
CP等買入		▲ 100	
貸出支援基金(成)	1,900	▲ 3,500	
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入		▲ 100	▲ 100
E T F 買入	200		
国債補充供給			
当預増減	▲ 10,600	▲ 40,200	2,000
当座預金残高	4,005,200	3,965,000	3,967,000
準備預金残高	3,473,400		
積み終了先	3,473,100		
超過準備	3,473,100		
非準備預金先	531,800		
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額			3,179,800
準備預金進捗率	実績	99.92%	日数
			61.29%

●2019年9月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.075~▲0.050%の出会いが中心となった。ビットサイドの様子見姿勢が強く、一巡後は▲0.080~▲0.075%で調整の出会いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で散発的に出会いが見られていた。

<レポ市場>

GCT/N(9/4~9/5)は、▲0.095~▲0.085%程度での出会い。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2Y402~403、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。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回と同額)でオファーされた。平均落札利回較差+0.012%、按分落札利回較差+0.010%と、在庫調整の売りから弱めの結果となった。その後のマーケットでは、引け際に1Y物が▲0.285%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は、電機・食品等からはややまとまったロットでの発行も見られたが、2,900億円程度の償還に対して、1,200億円強にとどまった。発行レートについては、概ね横ばい圏で推移したが、期越えの案件では強めの水準での決着も見られた。

●短期金融市場関連指標

2019/9/3	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.067				-	▲ 0.089	▲ 0.280	▲ 0.010	20,625.16	4.97	106.19-21	105.98-99
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.005	▲ 0.030				-	▲ 0.096						
2W			0.000				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.104						
1M							-	▲ 0.122						
3M			▲ 0.035				▲ 0.160	▲ 0.134						
6M							▲ 0.280	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.283	▲ 0.168						
									日付	8/27	8/28	8/29	8/30	9/2
									日銀当預残	4,041,600	4,036,400	4,034,600	4,036,500	4,015,800
									準備預金残	3,514,300	3,510,200	3,507,600	3,511,800	3,490,500
									マネタリーベース	5,164,500	5,159,300	5,158,100	5,159,700	5,138,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.041%	▲ 0.043%	▲ 0.050%	▲ 0.061%	▲ 0.063%
									コール市場残高	110,257	115,783	117,153	104,981	110,012
									うち無担	90,565	95,440	98,505	83,938	90,120
									うちO/N	55,620	59,665	62,200	53,393	58,380
									うち有担	19,692	20,343	18,648	21,043	19,892

●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)
10年利付国債	355	0.10%	21,000	2019/9/4	2029/6/20	61,611.0	17,130.00	103.6600	▲0.2640%	99.4435%	103.6800	▲0.2650%	3,857.0

●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	入札総額(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	2,500	2019/9/4			7,463	2,501	0.010		0.012	85.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/3	2019/9/4	▲ 0.350	42	42		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年9月4日の予定

*黒田日銀総裁、FIN/SUM 2019において講演	*米国ページブック	*交付税特別会計借入(10,600億円、9/13借入)
*片岡日銀審議委員、函館市金融経済懇談会において講演	*米国7月の貿易収支	
*9月の日銀当座預金増減要因見込み		

◆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