

Central Daily Market Report

2019年9月4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9月4日 需給速報		2019年9月5日 需給予想		2019年9月6日 当社予想	
銀行券	700		0		▲ 1,000	
財政	▲ 42,000		200		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 41,300		200		▲ 5,000	
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	2,500					
国債買入						
CP等買入				▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入			500			
国債補充供給	▲ 400			400		
当増減	▲ 39,300		500		▲ 5,000	
当座預金残高	3,965,900		3,966,400		3,961,400	
準備預金残高	3,461,800					
積み終了先	3,461,500		9月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,461,500		積数		2,100	
非準備預金先	504,100		1日平均		200	
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	99.93%	日数	64.52%		

●2019年9月4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%の出合いが中心となった。ビッドサイドは引き続き様子見姿勢が強く、調達水準を引き下げる先が散見された。ターム物に関してはショートターム物で散発的に出合いが見られていた。

<レポ市場>

GCT/N(9/5-9/6)は、▲0.095~▲0.085%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2Y402~403、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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散で、引け際に3M物が▲0.164%で出合った程度だった。

<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、償還1,200億円程度に対して、発行1,400億円程度となり、石油・商社等から大型発行が実施された。発行レートは引き続き0%近辺が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2019/9/4	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.067				-	▲ 0.084	▲ 0.290	▲ 0.010	20,649.14	23.98	105.85-86	106.23-24
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.008	▲ 0.039				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.021				-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.164	▲ 0.136						
6M							▲ 0.280	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.283	▲ 0.169						
									日付	8/28	8/29	8/30	9/2	9/3
									日銀当預残	4,036,400	4,034,600	4,036,500	4,015,800	4,005,200
									準備預金残	3,510,200	3,507,600	3,511,800	3,490,500	3,473,000
									マネタリーベース	5,159,300	5,158,100	5,159,700	5,138,300	5,127,200
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.050%	▲0.061%	▲0.063%	▲0.067%
									コール市場残高	115,783	117,153	104,981	110,012	110,110
									うち無担	95,440	98,505	83,938	90,120	87,330
									うちO/N	59,665	62,200	53,393	58,380	55,780
									うち有担	20,343	18,648	21,043	19,892	22,780

●入札結果

名称	回数	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I非価格競争入札(億円)
交付税特会	-	-	10,600	2019/9/13	2020/3/13	286,057.0	10,600.23		0.0000%	3.7057%		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	応募総額(億円・百万ドル)	着札総額(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	平均着札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/4	2019/9/5	▲ 0.350	402	402		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/9/6	2019/9/12	2.630	0	0				

●2019年9月5日の予定

*米国7月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国8月のISM非製造業景況指数

*30年利付国債入札
(7,000億円、9/6発行)

◆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選ばれ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