

# Central Daily Market Report

2019年9月5日(木)

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5日 需給速報		2019年9月6日 需給予想		2019年9月9日 当社予想	
銀行券	▲ 100		500		1,000	
財政	3,200		▲ 10,000		▲ 4,000	
資金過不足	3,100		▲ 9,500		▲ 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						▲ 900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 600		▲ 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	500					
国債補完供給	▲ 400	400		400		
当預増減	3,000		▲ 9,400		▲ 3,900	
当座預金残高	3,968,900		3,959,500		3,955,600	
準備預金残高	3,462,000					
積み終了先	3,461,700					
超過準備	3,461,700					9月6日以降の残り所要積立額 積数 1,800
非準備預金先	506,900					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	99.94%	日数	67.74%		

## ●2019年9月5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。一巡後は▲0.075%程度で調整の出合いが見られるのみだった。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(9/6-9/7)は、▲0.08~▲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2Y402~403、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、翌日に3M物の入札を控え動意なく閑散な中、3M物が▲0.164%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、700億円弱の償還に対して、発行は300億円弱にとどまる閑散なマーケットとなった。CP等買入オペは、事前予定通り4,000億円でオファーされ、平均落札レート▲0.003%、按分落札レート▲0.006%といずれも前回比で低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/9/5	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	▲ 0.275	0.015	21,085.94	436.80	106.34-35	106.51-52
T/N			▲ 0.045				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.035	▲ 0.045				-	▲ 0.091						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.098						
3W							-	▲ 0.104						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.164	▲ 0.137						
6M							▲ 0.280	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.283	▲ 0.171						
									日付	8/29	8/30	9/2	9/3	9/4
									日銀当預残	4,034,600	4,036,500	4,015,800	4,005,200	3,965,900
									準備預金残	3,507,600	3,511,800	3,490,500	3,473,000	3,460,500
									マネタリーベース	5,158,100	5,159,700	5,138,300	5,127,200	5,087,100
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.061%	▲0.063%	▲0.067%	▲0.067%
									コール市場残高	117,153	104,981	110,012	110,110	114,877
									うち無担	98,505	83,938	90,120	87,330	89,186
									うちO/N	62,200	53,393	58,380	55,780	55,836
									うち有担	18,648	21,043	19,892	22,780	25,691

## ●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)
30年利付国債	63	0.40%	7,000	2019/9/6	2049/6/20	19,759.0	5,728.00	107.3000	0.1440%	53.1585%	107.4100	0.1400%	1,263.0

## ●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
CP等買入	4,000	2019/9/10			6,368	3,993	▲0.006		▲0.003	31.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/5	2019/9/6	▲0.350	350	350		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年9月6日の予定

\*7月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+1.1%)  
\*7月の毎月勤労統計調査速報  
\*7月の景気動向指数速報  
\*8月のマネタリーベースと日本銀行の取引

\*米国8月の雇用統計  
\*ユーロ圏4-6月期のGDP確報値

\*国庫短期証券(855回)入札  
(3ヶ月、43,000億円、9/9発行)

◆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