

Central Daily Market Report

2019年9月6日(金)

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6日 需給速報	2019年9月9日 需給予想	2019年9月10日 当社予想
銀行券	600	1,100	0
財政	▲ 7,800	1,300	▲ 8,000
資金過不足	▲ 7,200	2,400	▲ 8,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		500	▲ 900
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		12,600	
CP等買入	▲ 300	▲ 200	4,000
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			
国債補完供給	▲ 100	400	100
当預増減	▲ 7,200	14,400	▲ 4,000
当座預金残高	3,961,700	3,976,100	3,972,100
準備預金残高	3,464,600		
積み終了先	3,464,400		
超過準備			9月9日以降の残り所要積立額 積数 1,100
非準備預金先	497,100		1日平均 200
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額			3,182,200
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数 77.42%

●2019年9月6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~▲0.045%の出会いが中心となった。週末3日積みの取引にあたり、一部で取り上がる先も見られていた。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(9/9-9/10)は、▲0.08%~▲0.09%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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.162%から▲0.165%まで買い進まれる展開となったものの、平均落札利回▲0.1619%、按分落札利回▲0.1563%とWI取引ほどの強さは見られない結果となった。結果発表後は相場が一変し、セカンダリーマーケットで新発3M物が▲0.160%から▲0.178%まで買い進まれるなど強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.300~▲0.290%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、400億円程度の償還に対して、発行も600億円強にとどまり、発行件数も少なく、閑散としたマーケットであった。発行レート水準に目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/9/6	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	▲ 0.064				-	▲ 0.084	▲ 0.250	0.025	21,199.57	113.63	107.06-08	106.97-99
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.030	▲ 0.050				-	▲ 0.091						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.099						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.174	▲ 0.137						
6M							▲ 0.280	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.300	▲ 0.171						
									日付	8/30	9/2	9/3	9/4	9/5
									日銀当預残	4,036,500	4,015,800	4,005,200	3,965,900	3,968,900
									準備預金残	3,511,800	3,490,500	3,473,000	3,460,500	3,462,000
									マネタリーベース	5,159,700	5,138,300	5,127,200	5,087,100	5,090,300
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.063%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.067%
									コール市場残高	104,981	110,012	110,110	114,877	115,135
									うち無担	83,938	90,120	87,330	89,186	89,299
									うちO/N	53,393	58,380	55,780	55,836	55,089
									うち有担	21,043	19,892	22,780	25,691	25,836

●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)
国庫短期証券	855	-	43,000	2019/9/9	2019/12/9	105,132.0	35,097.3	100.0390	▲0.1563%	91.1886%	100.0404	▲0.1619%	7,902.0

●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	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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/9/9	2019/9/24		508	508				
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/9/9			1,755	501	0.022		0.044	47.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2019/9/9			8,834	4,006	0.011		0.013	53.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,600	2019/9/9			9,793	3,606	0.016		0.017	48.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4000	2019/9/9			10,822	4,005	0.025		0.027	45.2
国債買入(物価連動債)	250	2019/9/9			874	251	▲0.070		▲0.129	100
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/6	2019/9/9	▲0.350	132	132		▲0.350	▲0.350	

●2019年9月9日の予定

*4-6月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率+1.3%)	*米国7月の消費者信用残高	*国庫短期証券(856回)入札(6ヶ月、23,000億円、9/10発行)
*7月の国際収支		*流動性供給入札(4,000億円、9/10発行)
*7月の特定サービス産業動態統計速報		
*8月の景気ウォッチャー調査		

◆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