

Central Daily Market Report

2019年9月9日(月)

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9日 需給速報	2019年9月10日 需給予想	2019年9月11日 当社予想
銀行券	800	700	1,000
財政	2,800	▲ 10,800	3,000
資金過不足	3,600	▲ 10,100	4,000
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		▲ 200	4,000 ▲ 500
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			200
国債補完供給	▲ 200	100	200
当預増減	15,400	▲ 6,200	4,000
当座預金残高	3,977,100	3,970,900	3,974,900
準備預金残高	3,484,600		
積み終了先	3,484,400		
超過準備	3,484,400		
非準備預金先	492,500		
9月10日以降の残り所要積立額			
			900
1日平均			
			100
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 80.65%

●2019年9月9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▲0.080~▲0.045%の出合いが中心となった。台風の影響から朝一の取引を見送る先が見られ、一巡後は取り上がる先も散見された。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>

GC T/N(9/10~9/11)は、▲0.09~▲0.06%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、発行日要因もあってか上昇した。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.290%から▲0.315%まで買い進まれる展開となったものの、平均落札利回▲0.2883%、按分落札利回▲0.2643%と、WI取引ほどの強さは見られず、テールも流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.290~▲0.280%での出合いが見られた。この他に、3M物が▲0.1775%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、電気機器・ガラス土石製品業態でまとまった発行があったものの、発行総額700億円程度に対して償還総額1,800億円程度と償還超となった。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

2019/9/9	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.067				-	▲ 0.083	▲ 0.260	▲ 0.010	21,318.42	118.85	106.94-95	106.96-97
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.050				-	▲ 0.089						
2W							-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.179	▲ 0.137						
6M							▲ 0.278	▲ 0.163						
1Y							▲ 0.300	▲ 0.171						
									日付	9/2	9/3	9/4	9/5	9/6
									日銀当預残	4,015,800	4,005,200	3,965,900	3,968,900	3,961,700
									準備預金残	3,490,500	3,473,000	3,460,500	3,462,000	3,464,600
									マネタリーベース	5,138,300	5,127,200	5,087,100	5,090,300	5,082,400
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.064%
									コール市場残高	110,012	110,110	114,877	115,135	125,394
									うち無担	90,120	87,330	89,186	89,299	99,941
									うちO/N	58,380	55,780	55,836	55,089	66,296
									うち有担	19,892	22,780	25,691	25,836	25,453

●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	856	-	23,000	2019/9/10	2020/3/10	81,431.0	18,785.9	100.1320	▲0.2643%	1.7613%	100.1440	▲0.2883%	4,214.0
流動性供給	293	-	4,000	2019/9/10		15,964.0	3,986.00		▲0.0150%	17.9104%		▲0.0170%	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/9	2019/9/10	▲ 0.350	189	189		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年9月10日の予定

*8月のマネーストック

*エネルギー対策借入
(7,000億円、9/20借入)

◆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