

Central Daily Market Report

2019年9月10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10日		2019年9月11日		2019年9月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		900		▲ 1,000	
財政	▲ 8,400		200		▲ 24,000	
資金過不足	▲ 7,700		1,100		▲ 25,000	
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						
国債買入						
CP等買入	4,000	▲ 500		▲ 200		
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	200		500			
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 3,800		1,400		▲ 25,000	
当座預金残高	3,973,300		3,974,700		3,949,700	
準備預金残高	3,467,300					
積み終了先	3,467,100				9月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,467,100				積数 600	
非準備預金先	506,000				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	99.98%	日数	83.87%		

●2019年9月10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~▲0.040%の出会いが中心となった。昨日台風の影響によって調達を見送った先等で、一部取り上がる動きが見られていた。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た。

<レポ市場>

GCT/N(9/11-9/12)は、▲0.06~▲0.04%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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.280~▲0.275%、1Y物が▲0.295%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、小売業態で大型発行が見られた。発行総額1,000億円程度に対して、償還総額は2,000億円程度となり償還超のマーケットとなった。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

2019/9/10	無担(速報)			有担(速報)			短期	東京レポレート	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	▲ 0.061				-	▲ 0.042	▲ 0.230	0.030	21,392.10	73.68	107.32-34	107.32-33
T/N							-	▲ 0.050						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.045				-	▲ 0.074						
2W							-	▲ 0.083						
3W			0.030				-	▲ 0.110						
1M			0.000				-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.179	▲ 0.135						
6M							▲ 0.275	▲ 0.166						
1Y							▲ 0.295	▲ 0.173						
									日付	9/3	9/4	9/5	9/6	9/9
									日銀当預残	4,005,200	3,965,900	3,968,900	3,961,700	3,977,100
									準備預金残	3,473,000	3,460,500	3,462,000	3,464,600	3,484,600
									マネタリーベース	5,127,200	5,087,100	5,090,300	5,082,400	5,097,000
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.064%	▲0.067%
									コール市場残高	110,110	114,877	115,135	125,394	103,637
									うち無担	87,330	89,186	89,299	99,941	81,666
									うちO/N	55,780	55,836	55,089	66,296	49,061
									うち有担	22,780	25,691	25,836	25,453	21,971

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
エネルギー対策	-	-	7,000	2019/9/20	2020/9/23	129,857.0	6,999.84		0.0000%	5.3905%		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	応札総額(億円)	落札総額(億円)	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)		2019/9/10	2019/9/11	▲ 0.350	37	37		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/9/12	2019/9/19	2.630	1	1				

●2019年9月11日の予定

*7-9月期の法人企業景気予測調査季報	*米国7月の卸売売上高	*5年利付国債入札(19,000億円、9/12発行)
	*米国8月の生産者物価指数	

◆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