

Central Daily Market Report

2019年9月11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11日		2019年9月12日		2019年9月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		▲ 500		▲ 1,000	
財政	▲ 600		▲ 21,800		6,000	
資金過不足	100		▲ 22,300		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			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 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				▲ 100		
E T F 買入	500					
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	300		▲ 17,600		5,000	
当座預金残高	3,973,600		3,956,000		3,961,000	
準備預金残高	3,465,400					
積み終了先	3,465,100					
超過準備	3,465,100				9月12日以降の残り所要積立額 積数 300	
非準備預金先	508,200				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	99.99%	日数	87.10%		

●2019年9月11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▲0.070~▲0.035%の出会いが中心となった。積み期も終盤にかけ、水準を上げて調達する先が散見された。ターム物に関してはショートターム物で散発的に出会いが見られていた。

<レポ市場>

GCT/N(9/12-9/13)は、▲0.06~▲0.01%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、積み期の終盤ということもあってか上昇。アウトライト市場では、短国買入オベが5,000億円(前回比+2,500億円)でオファーされた。オベ通告後に6M物が▲0.275~▲0.270%で出合う展開となる中、平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.002%と、在庫調整の売りからか小甘い結果となった。この他に、3M物が▲0.1825%、1Y物が▲0.295%で出会った。

<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、石油・ゴム製品業態等で大型発行が見られ、発行総額は2,200億円程度まで膨らんだものの、償還総額は3,200億円程度となり償還超となった。発行レート水準に目立った変動は見られなかった。本日はCP等買入オベがオファー額4,000億円で実施された。結果は平均落札レート▲0.006%・按分レート▲0.009%と両レートとも前回比(平均▲0.003%・按分▲0.006%)で低下した。

●短期金融市場関連指標

2019/9/11	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	▲ 0.055				-	▲ 0.051	▲ 0.210	0.020	21,597.76	205.66	107.59-61	107.80-81
T/N							-	▲ 0.052						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.076						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.179	▲ 0.137						
6M							▲ 0.275	▲ 0.167						
1Y							▲ 0.295	▲ 0.173						
									日付	9/4	9/5	9/6	9/9	9/10
									日銀当預残	3,965,900	3,968,900	3,961,700	3,977,100	3,973,300
									準備預金残	3,460,500	3,462,000	3,464,600	3,484,600	3,467,300
									マネタリーベース	5,087,100	5,090,300	5,082,400	5,097,000	5,092,600
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.067%	▲0.064%	▲0.067%	▲0.061%
									コール市場残高	114,877	115,135	125,394	103,637	117,117
									うち無担	89,186	89,299	99,941	81,666	94,004
									うちO/N	55,836	55,089	66,296	49,061	61,399
									うち有担	25,691	25,836	25,453	21,971	23,113

●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)
5年利付国債	140	0.10%	19,000	2019/9/12	2024/6/20	56,290.0	15,588.0	101.9500	▲0.3020%	47.6063%	101.9800	▲0.3080%	3,407.0

●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
国庫短期証券買入	5,000	2019/9/12			14,343	5,000	0.002		0.006	4
CP等買入	4,000	2019/9/17			7,550	3,988	▲0.009		▲0.006	58.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/11	2019/9/12	▲ 0.350	128	128		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年9月12日の予定

*7月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需・前月比▲9.9%)
*7月の第3次産業活動指数
*8月の企業物価指数

*ECB定例理事会(金融政策発表)
*米国8月の財政収支
*米国8月の消費者物価指数

◆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。

◆本資料は何ら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