

Central Daily Market Report

2019年9月12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12日		2019年9月13日		2019年9月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 100		1,000	
財政	▲ 21,800		1,800		11,000	
資金過不足	▲ 22,400		1,700		12,000	
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						▲ 2,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入			6,100			
CP等買入		▲ 300		▲ 400	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					13,000	▲ 7,300
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
ETF買入						
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 17,700		7,300		19,500	
当座預金残高	3,955,900		3,963,200		3,982,700	
準備預金残高	3,437,200					
積み終了先	3,437,000					
超過準備					9月13日以降の残り所要積立額 積数 100	
非準備預金先	518,700				1日平均 0	
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	100.00%	日数	90.32%		

●2019年9月12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▲0.060~▲0.025%の出会いが中心となった。祝日を含む週末での調整を嫌った先が散見され、レートを一段と切り上げての出会いとなった。ターム物に関してはショートターム物が散発的に出会いが見られていた。

<レポ市場>

GC T/N(9/13-9/17)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)は横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、3M物が▲0.175~▲0.170%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、電気機器業態1社で2,000億円近い発行が見られたものの、発行総額3,000億円程度に対して償還総額は4,300億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

2019/9/12	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.019	▲ 0.215	▲ 0.005		21,759.61	161.85	108.01-02	107.90-91
T/N							-	▲ 0.041							
S/N							-	-							
1W							-	▲ 0.069							
2W			▲ 0.018				-	▲ 0.083							
3W							-	▲ 0.112							
1M							-	▲ 0.114							
3M			▲ 0.030				▲ 0.175	▲ 0.138							
6M							▲ 0.275	▲ 0.167							
1Y							▲ 0.295	▲ 0.174							
									日付	9/5	9/6	9/9	9/10	9/11	
									日銀当預残	3,968,900	3,961,700	3,977,100	3,973,300	3,973,600	
									準備預金残	3,462,000	3,464,600	3,484,600	3,467,300	3,465,400	
									マネタリーベース	5,090,300	5,082,400	5,097,000	5,092,600	5,092,100	
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.064%	▲0.067%	▲0.061%	▲0.055%	
									コール市場残高	115,135	125,394	103,637	117,117	108,693	
									うち無担	89,299	99,941	81,666	94,004	86,514	
									うちO/N	55,089	66,296	49,061	61,399	54,709	
									うち有担	25,836	25,453	21,971	23,113	22,179	

●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)	募入最低値	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2019/9/13			7,579	4,002	0.004		0.006	9.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,400	2019/9/13			4,248	1,401	0.007		0.009	97.7
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/9/13			1,734	402	0.009		0.009	77.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/12	2019/9/13	▲ 0.250	43	43		▲ 0.250	▲ 0.250	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2019/9/17	2023/9/15	0	13,014

●2019年9月13日の予定

*米国7月の企業在庫	*国庫短期証券(857回)入札
*米国8月の小売売上高	(3ヶ月、42,800億円、9/17発行)
*米国9月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*流動性供給入札
	(6,000億円、9/17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