

# Central Daily Market Report

2019年9月13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13日		2019年9月17日		2019年9月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		1,000		0	
財政	▲ 1,400		6,100		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 1,500		7,100		▲ 1,000	
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	▲ 2,200		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,100					
CP等買入		▲ 400	4,000	▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			13,000	▲ 4,800		
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	4,000		18,700		▲ 1,000	
当座預金残高	3,959,900		3,978,600		3,977,600	
準備預金残高	3,432,300					
積み終了先	3,432,300				9月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,432,300				積数 587,400	
非準備預金先	527,600				1日平均 20,300	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,081,200	
準備預金進捗率	実績	80.94%	日数	3.33%		

## ●2019年9月13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▲0.065~▲0.020%の出会いが中心となった。一巡後は残ったビッドに対してギブンされる展開となり、▲0.080%近辺で出会いが散見された。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>

GC T/N(9/17-9/18)は、▲0.08~▲0.05%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、新積み期に入り低下した。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▲0.150~▲0.145%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.1431%、按分落札利回▲0.1236%と、前回債からレートが上昇し、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、▲0.134~▲0.130%と按分レート近辺で推移した。この他に、6M物が▲0.265~▲0.250%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、機械・卸売業態でまとまった調達が見られ、発行総額は1,600億円程度となったものの、償還総額は2,300億円程度となり償還超のマーケットとなった。発行レートは一部期越物でレート低下傾向が見られたが、概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/9/13	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.019	▲ 0.160	0.055	21,988.29	228.68	108.17-19	107.95-96
T/N							-	▲ 0.074						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.085						
2W							-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.109						
1M			0.025				-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.134	▲ 0.134						
6M							▲ 0.275	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.295	▲ 0.173						
									日付	9/6	9/9	9/10	9/11	9/12
									日銀当預残	3,961,700	3,977,100	3,973,300	3,973,600	3,955,900
									準備預金残	3,464,600	3,484,600	3,467,300	3,465,400	3,437,200
									マネタリーベース	5,082,400	5,097,000	5,092,600	5,092,100	5,075,000
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.067%	▲0.061%	▲0.055%	▲0.043%
									コール市場残高	125,394	103,637	117,117	108,693	106,345
									うち無担	99,941	81,666	94,004	86,514	86,329
									うちO/N	66,296	49,061	61,399	54,709	54,604
									うち有担	25,453	21,971	23,113	22,179	20,016

## ●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	857	-	42,800	2019/9/17	2019/12/16	90,278.0	34,939.0	100.0305	▲0.1236%	76.1000%	100.0353	▲0.1431%	7,861.0
流動性供給	294	-	6,000	2019/9/17		16,705.0	5,995.00		0.0430%	43.4516%		0.0380%	

## ●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	2019/9/17	2019/9/30		2,238	2,238				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/13	2019/9/17	▲0.250	113	113		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/9/13	2019/9/17	▲0.250	1	1		▲0.250	▲0.250	

## ●2019年9月17日の予定

\*7月の石油等消費動向統計

\*米国FOMC(1日目)

\*米国8月の鉱工業生産・設備稼働率

◆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