

# Central Daily Market Report

2019年9月17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17日		2019年9月18日		2019年9月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100		500		0	
財政	2,100		2,100		▲12,000	
資金過不足	3,200		2,600		▲12,000	
<b>金融調節</b>	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			7,700			
CP等買入	4,000	▲700		▲200		
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						
E T F 買入			700			
国債補完供給	▲200	100		200		
当預増減	14,600		11,000		▲12,000	
当座預金残高	3,974,500		3,985,500		3,973,500	
準備預金残高	3,489,100					
積み終了先	3,412,300					
超過準備	3,023,800					
非準備預金先	485,400					
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	96.04%	日数	6.67%		

## ●2019年9月17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。新積み期に入ったことから資金調達サイドが慎重な出足となった。▲0.075%で寄り付き後はBIDが厚くなる場面も見られ、こじっかりと推移。出合一巡後も▲0.060%近辺の出会いが散見された。ターム物に関しては特段目立った出会いが見られなかった。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(9/18-9/19)は、▲0.070～▲0.050%程度での出会い。SCはローラー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、5Y136～140、10Y335～355、30Y59～63、40Y9～12等にビッドの出入りが多く見られた。

### ＜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、3M物が▲0.140%で出合った。

### ＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、償還総額2,100億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と償還超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/9/17	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	▲0.065				-	▲0.063	▲0.155	0.005	22,001.32	13.03	108.14-16	108.12-13
T/N							-	▲0.062						
S/N							-	-						
1W	▲0.050	▲0.015	▲0.035				-	▲0.073						
2W			▲0.020				-	▲0.102						
3W							-	▲0.107						
1M			▲0.040				-	▲0.112						
3M							▲0.140	▲0.130						
6M							▲0.275	▲0.163						
1Y							▲0.295	▲0.171						
									日付	9/9	9/10	9/11	9/12	9/13
									日銀当預残	3,977,100	3,973,300	3,973,600	3,955,900	3,959,900
									準備預金残	3,484,600	3,467,300	3,465,400	3,437,200	3,432,300
									マネタリーベース	5,097,000	5,092,600	5,092,100	5,075,000	5,079,100
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.061%	▲0.055%	▲0.043%	▲0.042%
									コール市場残高	103,637	117,117	108,693	106,345	98,222
									うち無担	81,666	94,004	86,514	86,329	76,364
									うちO/N	49,061	61,399	54,709	54,604	47,789
									うち有担	21,971	23,113	22,179	20,016	21,858

## ●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	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1年超3年以下)	4,000	2019/9/18			13,405	4,005	▲0.005		▲0.005	88.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,600	2019/9/18			10,047	3,605	▲0.012		▲0.010	23.0
社債等買入	1,250	2019/9/24			2,910	1,250	▲0.067		▲0.054	96.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/17	2019/9/18	▲0.350	177	177		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/9/19	2019/9/26	2.460	3	3				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2019/9/18	2019/9/27		2	2		▲0.100	▲0.100	

## ●2019年9月18日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、19日まで)	*米国FOMC(2日目)	*国庫短期証券(858回)入札(1年、19,000億円、9/20発行)
*8月の貿易統計	*米国FRB経済見通し発表	*20年利付国債入札(9,000億円、9/19発行)
	*米国8月の住宅着工件数	
	*ユーロ圏8月の消費者物価指数改定値	
	*英国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