

Central Daily Market Report

2019年9月18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18日 需給速報	2019年9月19日 需給予想	2019年9月20日 当社予想			
銀行券	400	▲ 1,200	▲ 1,000			
財政	1,200	▲ 8,900	127,000			
資金過不足	1,600	▲ 10,100	126,000			
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	7,700					
CP等買入		▲ 200	▲ 400			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					800	▲ 800
社債等買入						
E T F 買入	700					
国債補完供給	▲ 300	200	300			
当預増減	9,700	▲ 10,200				126,000
当座預金残高	3,984,200	3,974,000				4,100,000
準備預金残高	3,483,500					
積み終了先	3,437,700					
超過準備	3,424,700				9月19日以降の残り所要積立額 積数 63,300 1日平均 2,300	
非準備預金先	500,700					
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	97.95%	日数			10.00%

●2019年9月18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・証券を中心に▲0.080~▲0.040%の出合いが中心となった。▲0.070%で寄り付き後は▲0.070~▲0.040%のレンジで推移した。出合い一巡後は調整から▲0.080%の出合いが見られた。ターム物に関してはロール案件の引合いが見られた程度で、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(9/19-9/20)は、▲0.075~▲0.055%程度での出合い。9/20利払い銘柄の有無で、出合いレートに幅が見られた。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、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。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.216~▲0.215%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.2200%、按分落札利回▲0.2171%とWI取引を反映して落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.252~▲0.240%と強含みで推移した。この他に、3M物が▲0.140%、6M物が▲0.265~▲0.260%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、20日発行にあたり、不動産・鉄鋼・機械業態で大型発行が観測されたが、9月末に向けて減額ロールする動きもあったことから、償還総額4,500億円程度に対して、発行総額は3,600億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

2019/9/18	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				-	▲ 0.058	▲ 0.186	▲ 0.031	21,960.71	▲ 40.61	108.10-11	108.19-20
T/N							-	▲ 0.067						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.005	▲ 0.023				-	▲ 0.078						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.107						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.140	▲ 0.129						
6M							▲ 0.275	▲ 0.162						
1Y							▲ 0.253	▲ 0.170						
									日付	9/10	9/11	9/12	9/13	9/17
									日銀当預残	3,973,300	3,973,600	3,955,900	3,959,900	3,974,500
									準備預金残	3,467,300	3,465,400	3,437,200	3,432,300	3,488,600
									マネタリーベース	5,092,600	5,092,100	5,075,000	5,079,100	5,092,600
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.055%	▲0.043%	▲0.042%	▲0.065%
									コール市場残高	117,117	108,693	106,345	98,222	113,706
									うち無担	94,004	86,514	86,329	76,364	90,655
									うちO/N	61,399	54,709	54,604	47,789	60,560
									うち有担	23,113	22,179	20,016	21,858	23,051

●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	858	-	19,000	2019/9/20	2020/9/23	79,604.0	15,789.8	100.2200	▲0.2171%	10.8235%	100.2230	▲0.2200%	3,210.0
20年利付国債	169	0.30%	9,000	2019/9/19	2039/6/20	25,654.0	7,380.00	101.7000	0.2100%	20.3703%	101.7900	0.2050%	1,617.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/9/18	2019/9/19	▲0.350	298	298		▲0.350	▲0.350	
被災地金融支援オペ	第101回	2019/9/20	2020/9/18	0		807				
被災地金融支援オペ(熊本)	第40回	2019/9/20	2020/9/18	0		0				

●2019年9月19日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*英中銀MPC結果発表
*日銀総裁例会見	*米国8月の中古住宅販売
*月例経済報告	

◆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