

Central Daily Market Report

2019年9月26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26日		2019年9月27日		2019年9月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 800			800
財政	▲ 9,200		▲ 11,300			▲ 1,800
資金過不足	▲ 10,500		▲ 12,100			▲ 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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	7,500					
国債買入			4,000			
CP等買入		▲ 700		▲ 600	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 500	1,100		500		
当預増減	▲ 3,400		▲ 8,200			800
当座預金残高	4,097,600		4,089,400			4,090,200
準備預金残高	3,562,500					
積み終了先	3,561,400				9月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,561,200				積数	11,600
非準備預金先	535,100				1日平均	600
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	99.62%	日数	36.67%		

●2019年9月26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～▲0.020%の出合いが中心となった。引き続き資金調達サイドはしっかりしており、立ち上がりは▲0.065～▲0.025%のレンジで推移した。出合一巡後も▲0.070～▲0.050%ではBID残りの展開となった。午後は目途をつけた出しが多く、出合いなく閑散。ターム物に関しては特段目立った出合いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/N(9/27-9/30)は、▲0.115～▲0.095%程度での出合い。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2Y402～404、10Y335～355、5Y136～140、30Y59～63、40Y9～11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、低水準で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散で、引け際に6M物と1Y物が▲0.310%で少額出合った程度だった。

＜CP市場＞

現先レートは横ばい圏で推移した。発行市場は期末を控え、調達を控える発行体も多く、償還総額3兆7,200億円程度に対し、発行総額は7,000億円程度と大幅な償還超となった。発行レートは概ね0%近辺のレンジで推移しているが、一部ではマイナス圏でレートを切り下げる銘柄も見られた。

●短期金融市場関連指標

2019/9/26	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	▲ 0.055				-	▲ 0.091	▲ 0.250	0.010	22,048.24	28.09	107.70-71	107.68-69
T/N	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.035				-	▲ 0.111						
S/N			▲ 0.055				-	-						
1W			▲ 0.005				-	▲ 0.127						
2W							-	▲ 0.121						
3W							-	▲ 0.119						
1M							-	▲ 0.124						
3M	▲ 0.010	0.180	0.010				▲ 0.143	▲ 0.143						
6M							▲ 0.310	▲ 0.167						
1Y							▲ 0.310	▲ 0.181						
									日付	9/18	9/19	9/20	9/24	9/25
									日銀当預残	3,984,200	3,973,400	4,095,600	4,095,900	4,101,000
									準備預金残	3,483,500	3,451,800	3,569,200	3,579,900	3,563,000
									マネタリーベース	5,102,000	5,092,300	5,215,300	5,215,200	5,219,900
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.065%	▲0.057%	▲0.059%	▲0.058%
									コール市場残高	120,997	122,347	122,164	115,038	113,186
									うち無担	97,544	100,072	101,125	92,020	91,954
									うちO/N	66,079	67,177	69,210	61,715	60,939
									うち有担	23,453	22,275	21,039	23,018	21,232

●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5年超10年以下)	3,500	2019/9/27			9,882	3,507	0.007		0.009	68.9
国債買入(物価連動債)	250	2019/9/27			1,454	251	▲0.110		▲0.114	64.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2019/9/26	2019/9/27	▲0.350	453	453		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2019/9/26	2019/9/27	▲0.350	23	23		▲0.350	▲0.350	

●2019年9月27日の予定

*9月の都区部消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.6%	*米国8月の耐久財新規受注 *米国8月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(860回)入札 (3ヶ月、42,700億円、9/30発行) *2年利付国債入札 (20,000億円、10/1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