

●資金需給

単位：億円	2019年9月2日 需給速報	2019年9月3日 需給予想	2019年9月4日 当社予想
銀行券	700	600	0
財政	▲ 33,800	▲ 13,700	▲ 40,000
資金過不足	▲ 33,100	▲ 13,100	▲ 40,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出	スタート	エンド	スタート
全店共通	2,200	▲ 2,300	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	12,400	2,100	
CP等買入		▲ 100	▲ 100
貸出支援基金(成)		1,900	▲ 3,500
貸出支援基金(貸)			▲ 100
被災地支援			
社債等買入		▲ 100	▲ 100
E T F 買入		200	
国債補完供給		300	
当預増減	▲ 20,700	▲ 12,600	▲ 40,100
当座預金残高	4,015,800	4,003,200	3,963,100
準備預金残高	3,490,500		
積み終了先	3,490,200		9月3日以降の残り所要積立額
超過準備	3,490,200		積数 2,700
非準備預金先	525,300		1日平均 200
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額			3,179,800
準備預金進捗率	実績	99.92%	日数 58.06%

●2019年9月2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～▲0.050%の出合いが中心となった。積み期後半を迎えたものの、月末要因で低下した水準を引き継ぎ弱含みでの推移となった。ターム物に関してはショートターム物で散発的に出合いが見られていた。

＜レポ市場＞

GC T/N(9/3-9/4)は、▲0.12～▲0.09%程度での出合い。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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.163～▲0.160%、1Y物が▲0.290～▲0.289%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、償還が少なかったこともあり、発行は限定的で閑散なマーケットになった。レート水準に目立った変化は見られていない。

●短期金融市場関連指標

2019/9/2	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.089	▲ 0.270	0.010	20,620.19	▲ 84.18	106.13-14	106.25-27
T/N							-	▲ 0.117						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.112						
2W			0.000				-	▲ 0.113						
3W							-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.160	▲ 0.133						
6M							▲ 0.280	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.289	▲ 0.168						
									日付	8/26	8/27	8/28	8/29	8/30
									日銀当預残	4,037,500	4,041,600	4,036,400	4,034,600	4,036,500
									準備預金残	3,512,600	3,514,300	3,510,200	3,507,600	3,511,800
									マネタリーベース	5,160,400	5,164,500	5,159,300	5,158,100	5,159,700
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.041%	▲0.043%	▲0.050%	▲0.061%
									コール市場残高	110,077	110,257	115,783	117,153	104,981
									うち無担	89,884	90,565	95,440	98,505	83,938
									うちO/N	55,419	55,620	59,665	62,200	53,393
									うち有担	20,193	19,692	20,343	18,648	21,043

●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10年超25年以下)	1,400	2019/9/3			4,999	1,406	0.013		0.014	49.2
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/9/3			1,437	406	0.012		0.014	49.6

●2019年9月3日の予定

*8月実績/9月見込み財政資金対民間収支 *8月のマネタリーベース	*米国7月の建設支出 *米国8月のISM製造業景況指数	*10年利付国債入札 (21,000億円、9/4発行)
--------------------------------------	--------------------------------	--------------------------------

◆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。
◆本資料は何ら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論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