

Central Daily Market Report

2019年8月13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8月13日		2019年8月14日		2019年8月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		700		0	
財政	3,100		▲ 4,200		73,000	
資金過不足	3,300		▲ 3,500		73,000	
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	600	▲ 700				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,000					
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入				▲ 100		
E T F 買入	600		100			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	13,300		▲ 3,600		73,000	
当座預金残高	3,975,900		3,972,300		4,045,300	
準備預金残高	3,460,600					
積み終了先	3,460,400				8月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,460,400				積数	
非準備預金先	515,300				1日平均	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,187,400	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	93.55%		

●2019年8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、証券業態を中心に▲0.03~▲0.01%での調達で始まった。引き続き調達意欲は強く、一巡後も▲0.02%近辺での出会いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(8/14-8/15)は、▲0.11~▲0.10%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10Y335~355、5Y136~140、30Y59~62、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、低下した。アウトライト市場は、債券相場全体が堅調に推移する中、3M物が▲0.117~▲0.115%、6M物が▲0.220%、1Y物が▲0.230%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、お盆期間で閑散としており、償還総額2,150億円程度に対して、発行総額は150億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

2019/8/13	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.101	▲ 0.240	▲ 0.017	20,455.44	▲ 229.38	105.37-39	105.19-20
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.110						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.021				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.117	▲ 0.115						
6M							▲ 0.222	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.235	▲ 0.162						
									日付	8/5	8/6	8/7	8/8	8/9
									日銀当預残	3,960,300	3,965,500	3,964,600	3,966,800	3,962,600
									準備預金残	3,467,300	3,458,700	3,447,600	3,455,400	3,446,400
									マネタリーベース	5,083,100	5,087,900	5,087,100	5,090,300	5,087,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.050%	▲ 0.031%	▲ 0.032%	▲ 0.033%	▲ 0.029%
									コール市場残高	99,331	97,646	110,132	99,919	104,732
									うち無担	79,654	79,373	90,552	81,895	86,746
									うちO/N	47,084	46,113	57,712	52,645	56,856
									うち有担	19,677	18,273	19,580	18,024	17,986

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/13	2019/8/14	▲ 0.350	195	195		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/8/15	2019/8/22	2.63	0	0				

●2019年8月14日の予定

*6月の機械受注統計 市場予想：船舶、電力除く民需、前月比▲1.3%	*英国7月の消費者物価指数 *ユーロ圏4-6月期のGDP2次速報	*交付税特別会計借入 (10,500億円、8/22借入)
---------------------------------------	-------------------------------------	---------------------------------

◆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お客様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