

Central Daily Market Report

2019年8月15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8月15日		2019年8月16日		2019年8月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		600		1,000	
財政	75,700		▲ 22,600		▲ 4,000	
資金過不足	75,000		▲ 22,000		▲ 3,000	
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						▲ 2,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
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			700			
国債補完供給						
当預増減	79,700		▲ 21,600		▲ 5,300	
当座預金残高	4,050,900		4,029,300		4,024,000	
準備預金残高	3,516,300					
積み終了先	3,516,300				8月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,516,300				積数 3,179,400	
非準備預金先	534,600				1日平均 102,600	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					3,179,400	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2019年8月15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▲0.02~▲0.005%での調達で始まった。年金定時払いで大幅な資金余剰日であるものの、引き続き着地に向けた調整の調達ニーズが強く、昨日よりもレート水準が上昇した。一巡後はビッドが薄くなり、▲0.03%近辺での出合いが散見される程度で、今積み期の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.04%近辺での出合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(8/16-8/19)は、▲0.095~▲0.075%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10Y335~355、5Y136~139、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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、翌日に3M物の入札を控えて動意なく閑散な中、3M物が▲0.120~▲0.119%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、引き続き案件が少なく、償還総額230億円程度に対して、発行総額は140億円程度と若干の償還超となった。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

2019/8/15	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.090	▲ 0.242	▲ 0.017					
T/N							-	▲ 0.088							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.038				-	▲ 0.093							
2W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.035				-	▲ 0.093							
3W			0.001				-	▲ 0.097							
1M							-	▲ 0.101							
3M							▲ 0.119	▲ 0.117							
6M							▲ 0.235	▲ 0.150							
1Y							▲ 0.230	▲ 0.162							
									日付	8/7	8/8	8/9	8/13	8/14	
									日銀当預残	3,964,600	3,966,800	3,962,600	3,975,900	3,971,200	
									準備預金残	3,447,600	3,455,400	3,446,400	3,460,600	3,452,200	
									マネタリーベース	5,087,100	5,090,300	5,087,000	5,100,100	5,094,600	
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.033%	▲0.029%	▲0.025%	▲0.019%	
									コール市場残高	110,132	99,919	104,732	104,106	112,760	
									うち無担	90,552	81,895	86,746	86,286	93,429	
									うちO/N	57,712	52,645	56,856	56,886	63,899	
									うち有担	19,580	18,024	17,986	17,820	19,331	

●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)
5年利付国債	140	0.10%	19,000	2019/8/16	2024/6/20	73,189.0	15,649.0	102.0200	▲0.3100%	37.9896%	102.0400	▲0.3140%	3,336.0

●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)		2019/8/15	2019/8/16	▲ 0.350	0	0				

●2019年8月16日の予定

*米国7月の住宅着工件数	*国庫短期証券(851回)入札(3ヶ月、43,000億円、8/19発行)	*国有林野借入(964億円、8/26借入)
*米国8月のミシガン大消費者信頼感指数速報		

◆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