

Central Daily Market Report

2019年8月16日(金)

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16日 需給速報	2019年8月19日 需給予想	2019年8月20日 当社予想
銀行券	800	900	0
財政	▲ 21,000	▲ 2,400	▲ 9,000
資金過不足	▲ 20,200	▲ 1,500	▲ 9,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,300	▲ 2,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		4,700	
CP等買入		▲ 200	▲ 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	100	
国債補充供給			
当預増減	▲ 19,800	3,100	▲ 9,000
当座預金残高	4,031,100	4,034,200	4,025,200
準備預金残高	3,489,400		
積み終了先	3,444,000		
超過準備	2,449,800		
非準備預金先	541,700		
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	98.09%	日数
			9.68%

●2019年8月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、都銀、地銀、証券業態を中心に▲0.07~▲0.05%での調達で始まった。新積み期となったことで調達サイドの取り急ぐ動きが落ち着いたことから、前日比でレートは低下し、出合いのレンジは▲0.08~▲0.045%となった。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(8/19-8/20)は、▲0.085~▲0.075%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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.123~▲0.120%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1222%、按分落札利回▲0.1162%とWI取引を反映してしっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.140~▲0.130%出合いと強含みで推移した。この他に、6M物が▲0.245%、1Y物が▲0.240%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日発行にあたり石油・鉄鋼業態から大型発行が観測され、償還総額1,550億円程度に対して、発行総額は1,850億円程度と発行超となった。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

2019/8/16	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	▲ 0.057				-	▲ 0.085	▲ 0.240	0.002	20,418.81	13.16	106.09-10	106.16-17
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.043				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.047	▲ 0.025	▲ 0.038				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.097						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.140	▲ 0.118						
6M							▲ 0.245	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.235	▲ 0.162						
日付		8/8	8/9	8/13	8/14	8/15								
日銀当預残		3,966,800	3,962,600	3,975,900	3,971,200	4,050,900								
準備預金残		3,455,400	3,446,400	3,460,600	3,452,200	3,516,300								
マネタリーベース		5,090,300	5,087,000	5,100,100	5,094,600	5,175,100								
無担O/N加重平均		▲0.033%	▲0.029%	▲0.025%	▲0.019%	▲0.020%								
コール市場残高		99,919	104,732	104,106	112,760	111,619								
うち無担		81,895	86,746	86,286	93,429	93,833								
うちO/N		52,645	56,856	56,886	63,899	64,253								
うち有担		18,024	17,986	17,820	19,331	17,786								

●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	851	-	43,000	2019/8/19	2019/11/18	134,036.9	35,097.4	100.0290	▲0.1162%	46.0492%	100.0305	▲0.1222%	7,902.0
国有林野借入	-	-	964	2019/8/26	2024/8/25	3,393.0	964.00		0.0000%	50.0000%		0.0000%	

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2019/8/19	2019/9/2		2,307	2,307				
国債買入(残存期間5年起10年以下)	4,500	2019/8/19			13,485	4,501	▲0.007		▲0.006	17.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/16	2019/8/19	-0.35	4	4		▲0.350	▲0.350	

●2019年8月19日の予定

*6月の石油等消費動態統計 *7月の貿易統計	*ユーロ圏7月の消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(852回)入札 (1年、19,000億円、8/20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