

Central Daily Market Report

2019年8月19日(月)
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19日		2019年8月20日		2019年8月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		400		0	
財政	▲ 4,400		▲ 12,800		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 3,500		▲ 12,400		▲ 11,000	
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	▲ 2,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	4,700		7,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
E T F 買入	100		700			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	1,000		▲ 4,200		▲ 11,000	
当座預金残高	4,032,100		4,027,900		4,016,900	
準備預金残高	3,503,500					
積み終了先	3,483,800					
超過準備	3,475,300				8月20日以降の残り所要積立額 積数 32,500 1日平均 1,200	
非準備預金先	528,600					
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	98.98%	日数	12.90%		

●2019年8月19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▲0.07~▲0.055%での調達で始まった。積み期序盤であることから前日比横ばいで推移し、出合いのレンジは▲0.08~▲0.04%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(8/20-8/21)は、▲0.09~▲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、5Y136~140、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、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.215%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.2367%、按分落札利回▲0.2228%と前回債よりレートが低下する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.255~▲0.245%出合いと強含みで推移した。この他に、3M物が▲0.142~▲0.140%、6M物が▲0.250%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場はお盆休み明けとなったものの案件は膨らまず、償還総額1,500億円程度に対し、発行総額は900億円弱と償還超となった。発行レートは0%近辺の狭いレンジで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/8/19	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	▲ 0.060				-	▲ 0.084	▲ 0.235	0.005	20,563.16	144.35	106.42-43	106.40-41
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.093						
3W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.096						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.142	▲ 0.120						
6M							▲ 0.250	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.253	▲ 0.162						
									日付	8/9	8/13	8/14	8/15	8/16
									日銀当預残	3,962,600	3,975,900	3,971,200	4,050,900	4,031,100
									準備預金残	3,446,400	3,460,600	3,452,200	3,516,300	3,489,400
									マネタリーベース	5,087,000	5,100,100	5,094,600	5,175,100	5,154,400
									無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.025%	▲0.019%	▲0.020%	▲0.057%
									コール市場残高	104,732	104,106	112,760	111,619	111,710
									うち無担	86,746	86,286	93,429	93,833	91,547
									うちO/N	56,856	56,886	63,899	64,253	60,767
									うち有担	17,986	17,820	19,331	17,786	20,163

●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	852	-	19,000	2019/8/20	2020/8/20	82,291.0	15,561.9	100.2240	▲0.2228%	10.4888%	100.2380	▲0.2367%	3,438.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2019/8/20			9,021	4,002	0.001		0.004	65.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,600	2019/8/20			7,421	3,604	0.001		0.002	93.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/19	2019/8/20	-0.35	52	52		▲0.350	▲0.350	

●2019年8月20日の予定

*20年利付国債入札
(9,000億円、8/21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