

Central Daily Market Report

2019年8月20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20日		2019年8月21日		2019年8月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		100		▲ 1,000	
財政	▲ 13,200		▲ 11,500		1,000	
資金過不足	▲ 12,700		▲ 11,400		0	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,700					
CP等買入		▲ 300		▲ 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	700		100			
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 4,500		▲ 11,600		0	
当座預金残高	4,027,600		4,016,000		4,016,000	
準備預金残高	3,478,100					
積み終了先	3,470,400				8月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,460,600				積数	
非準備預金先	549,500				1日平均	
					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	99.53%	日数	16.13%		

●2019年8月20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~▲0.05%のレンジの調達で始まった。出来高、レート共に前日から概ね横ばいで、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引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(8/21-8/22)は、▲0.09~▲0.08%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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.145~▲0.1425%で出合った。また、引け際に6M物が▲0.255~▲0.250%、1Y物が▲0.262~▲0.253%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、化学、電気機器、非鉄金属等の業態で比較的多くまとった額の調達を実施され、発行総額は1,700億円程度と償還総額の1,100億円程度を上回った。発行レートは引続き0%近辺で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/8/20	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.059				-	▲ 0.080	▲ 0.240	▲ 0.005	20,677.22	114.06	106.56-58	106.46-47
T/N							-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.230	▲ 0.020				-	▲ 0.088						
2W							-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.145	▲ 0.120						
6M							▲ 0.250	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.259	▲ 0.162						
									日付	8/13	8/14	8/15	8/16	8/19
									日銀当預残	3,975,900	3,971,200	4,050,900	4,031,100	4,032,100
									準備預金残	3,460,600	3,452,200	3,516,300	3,489,400	3,503,200
									マネタリーベース	5,100,100	5,094,600	5,175,100	5,154,400	5,154,400
									無担O/N加重平均	▲0.025%	▲0.019%	▲0.020%	▲0.057%	▲0.061%
									コール市場残高	104,106	112,760	111,619	111,710	111,873
									うち無担	86,286	93,429	93,833	91,547	90,233
									うちO/N	56,886	63,899	64,253	60,767	58,683
									うち有担	17,820	19,331	17,786	20,163	21,640

●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)
20年利付国債	169	0.30%	9,000	2019/8/21	2039/6/20	27,674.0	7,266.00	103.6000	0.1140%	32.8061%	103.6700	0.1100%	1,724.0

●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
社債等買入	1,250	2019/8/26			2,756	1,250	▲0.083		▲0.073	61.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/20	2019/8/21	-0.35	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/8/20	2019/8/21	-0.35	1	1		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/8/22	2019/8/29	2.64	3	3				

●2019年8月21日の予定

*米国7月の中古住宅販売

*交付税特別会計借入
(10,500億円、8/30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