

Central Daily Market Report

2019年8月21日(水)

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21日		2019年8月22日		2019年8月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 900		0	
財政	▲ 13,800		▲ 1,000		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 13,800		▲ 1,900		▲ 6,000	
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						
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		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					900	▲ 900
社債等買入						
E T F 買入	100					
国債補完供給						
当預増減	▲ 14,000		2,600		▲ 6,000	
当座預金残高	4,013,600		4,016,200		4,010,200	
準備預金残高	3,470,800					
積み終了先	3,468,400				8月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,467,200				積数 11,400	
非準備預金先	542,800				1日平均 500	
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	99.64%	日数	19.35%		

●2019年8月21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%のレンジで調達が始まった。積み期序盤であることから、引き続き落ち着いた地合いで、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(8/22-8/23)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、短国買入オペアが5,000億円(前回と同額)でオファーされた。オペア後3M物で▲0.145%の出合いが見られる中、平均落札利回較差+0.010%、按分落札利回較差+0.004%と、在庫調整の売りからか小甘い結果となった。その後のマーケットでは、3M物が▲0.1425%、1Y物が▲0.263~▲0.255%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。発行市場は、卸売、石油・石炭業態で比較的多量に調達が行われた他は小口の案件が多く、発行総額は1,300億円弱にとどまった一方、大型案件の落ちがあったため、償還総額は2,600億円程度となり、償還超のマーケットとなった。発行レートは引続き0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/8/21	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	▲ 0.058				-	▲ 0.085	▲ 0.245	▲ 0.005	20,618.57	▲ 58.65	106.27-29	106.54-56
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.036				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.095						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.145	▲ 0.120						
6M							▲ 0.250	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.263	▲ 0.163						
									日付	8/14	8/15	8/16	8/19	8/20
									日銀当預残	3,971,200	4,050,900	4,031,100	4,032,100	4,027,600
									準備預金残	3,452,200	3,516,300	3,489,400	3,503,200	3,478,100
									マネタリーベース	5,094,600	5,175,100	5,154,400	5,154,400	5,149,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.020%	▲ 0.057%	▲ 0.061%	▲ 0.059%
									コール市場残高	112,760	111,619	111,710	111,873	110,445
									うち無担	93,429	93,833	91,547	90,233	88,403
									うちO/N	63,899	64,253	60,767	58,683	56,773
									うち有担	19,331	17,786	20,163	21,640	22,042

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/8/30	2020/2/28	261,740.0	10,500.20		0.0000%	4.0118%		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
国庫短期証券買入	5,000	2019/8/22			18,586	5,003	0.004		0.010	27.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/21	2019/8/22	-0.35	11	11		▲0.350	▲0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第100回 2019/8/23	2020/8/21	0	428
被災地金融支援オペ(熊本)	第39回 2019/8/23	2020/8/21	0	500

●2019年8月22日の予定

*流動性供給入札
(6,000億円、8/23発行)

◆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