

Central Daily Market Report

2019年8月22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22日		2019年8月23日		2019年8月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 500		1,000	
財政	100		1,100		3,000	
資金過不足	▲ 900		600		4,000	
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						▲ 600
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		▲ 500		▲ 400		
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					1,300	
E T F 買入			700			
国債補完供給	▲ 400			400		
当預増減	3,200		1,300		4,700	
当座預金残高	4,016,800		4,018,100		4,022,800	
準備預金残高	3,478,100					
積み終了先	3,476,300				8月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,476,000				積数 9,300	
非準備預金先	538,700				1日平均 400	
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	99.71%	日数	22.58%		

●2019年8月22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▲0.065~▲0.045%のレンジで調達が始まった。前日比で若干の上昇が見られたが、引き続き積み期序盤であることから落ち着いた地合いで、出合いのレンジは▲0.08~▲0.03%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(8/23-8/26)は、▲0.085~▲0.07%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、翌日に3M物の入札を控えて動意なく閑散な中、3M物が▲0.150~▲0.145%、6M物が▲0.250%、1Y物が▲0.263%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、鉄鋼、化学、ノンバンク等でまとまった額での調達が見られたが、案件は膨らまず、発行総額1,100億円弱、償還総額2,200億円弱と償還超となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/8/22	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				-	▲ 0.078	▲ 0.245	0.000	20,628.01	9.44	106.59-60	106.44-45
T/N							-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.084						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.145	▲ 0.120						
6M							▲ 0.250	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.265	▲ 0.163						
									日付	8/15	8/16	8/19	8/20	8/21
									日銀当預残	4,050,900	4,031,100	4,032,100	4,027,600	4,013,600
									準備預金残	3,516,300	3,489,400	3,503,200	3,478,100	3,470,800
									マネタリーベース	5,175,100	5,154,400	5,154,400	5,149,500	5,135,400
									無担O/N加重平均	▲0.020%	▲0.057%	▲0.061%	▲0.059%	▲0.058%
									コール市場残高	111,619	111,710	111,873	110,445	107,001
									うち無担	93,833	91,547	90,233	88,403	87,411
									うちO/N	64,253	60,767	58,683	56,773	54,191
									うち有担	17,786	20,163	21,640	22,042	19,590

●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)
流動性供給	291	-	6,000	2019/8/23		17,173.0	5,985.0		▲0.0010%	28.0664%		▲0.0030%	

●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)		2019/8/22	2019/8/23	▲ 0.350	20	20		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/8/22	2019/8/23	▲ 0.350	326	326		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年8月23日の予定

*7月の全国消費者物価指数(CPI)

市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.6%

*米国7月の新築一戸建て販売件数

*国庫短期証券(853回)入札

(3ヶ月、42,600億円、8/26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