

Central Daily Market Report

2019年8月23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23日 需給速報	2019年8月26日 需給予想	2019年8月27日 当社予想
銀行券	▲ 500	600	0
財政	700	3,500	1,000
資金過不足	200	4,100	1,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		900	▲ 600
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		12,600	
CP等買入		▲ 400	▲ 500
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入	900	▲ 900	
E T F 買入	700	700	
国債補完供給		400	
当預増減	900	18,500	1,000
当座預金残高	4,017,700	4,036,200	4,037,200
準備預金残高	3,496,900		
積み終了先	3,496,200		
超過準備	3,496,100		
非準備預金先	520,800		
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	99.78%	日数
			32.26%

●2019年8月23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▲0.06~▲0.045%のレンジで調達が始まった。3日積みということもあり邦銀業態の調達ニーズが強く、前日比でレートが上昇した。出会いのレンジは▲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引き合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(8/26-8/27)は、▲0.085~▲0.07%程度での出会い。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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.144%から▲0.148%まで買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1463%、按分落札利回▲0.1383%とWI取引ほどの強さは見られない結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.156~▲0.145%出会いと強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.255%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行案件は3件のみと閑散なマーケットとなった。発行総額は150億円程度に留まる一方、1,000億円弱の大型発行の落ちがあったことが影響し、償還総額は1,300億円程度と償還超となった。発行レートに特段の変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/8/23	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	▲ 0.052				-	▲ 0.080	▲ 0.240	0.005	20,710.91	82.90	106.46-48	106.64-65
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.250	▲ 0.039				-	▲ 0.086						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.087						
3W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.100						
3M			▲ 0.030				▲ 0.156	▲ 0.121						
6M							▲ 0.250	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.265	▲ 0.163						
									日付	8/16	8/19	8/20	8/21	8/22
									日銀当預残	4,031,100	4,032,100	4,027,600	4,013,600	4,016,800
									準備預金残	3,489,400	3,503,200	3,478,100	3,470,800	3,478,100
									マネタリーベース	5,154,400	5,154,400	5,149,500	5,135,400	5,139,700
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.061%	▲0.059%	▲0.058%	▲0.058%
									コール市場残高	111,710	111,873	110,445	107,001	117,145
									うち無担	91,547	90,233	88,403	87,411	95,078
									うちO/N	60,767	58,683	56,773	54,191	61,333
									うち有担	20,163	21,640	22,042	19,590	22,067

●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)	募入最低値	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	853	-	42,600	2019/8/26	2019/11/25	127,180.0	34,812.6	100.0345	▲0.1383%	75.9501%	100.0365	▲0.1463%	7,787.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2019/8/26	2019/9/9		937	937				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2019/8/26			15,760	4,006	0.008		0.010	33.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,600	2019/8/26			9,940	3,602	0.005		0.006	79.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2019/8/26			8,451	4,502	0.000		0.006	12.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/23	2019/8/26	▲ 0.350	9	9		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/8/23	2019/8/26	▲ 0.350	17	17		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年8月26日の予定

*6月の景気動向指数改訂状況

*米国7月の耐久財新規受注

*英国休日(Summer Bank Holiday)

◆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