

Central Daily Market Report

2019年8月26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26日 需給速報	2019年8月27日 需給予想	2019年8月28日 当社予想
銀行券	500	100	0
財政	4,900	1,000	▲ 5,000
資金過不足	5,400	1,100	▲ 5,000
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	2,700	
CP等買入		▲ 500	▲ 200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入	1,300		
E T F 買入	700	600	
国債補完供給			
当預増減	19,800	4,200	▲ 5,000
当座預金残高	4,037,500	4,041,700	4,036,700
準備預金残高	3,512,600		
積み終了先	3,511,800		
超過準備	3,511,800		
非準備預金先	524,900		
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	99.80%	日数
			35.48%

●2019年8月26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▲0.05~▲0.04%のレンジで調達が始まった。引き続き地銀・信託業態の調達ニーズが強く、レートは前日比で上昇した。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引き合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(8/27-8/28)は、▲0.085~▲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、小幅低下した。アウトライト市場は、債券市場全体が強含みで推移する中、3M物が▲0.159%、6M物が▲0.260~▲0.255%、1Y物が▲0.286~▲0.278%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額700億円程度に対して、発行総額は1,200億円程度と発行超であった。一部のその他金融業態から大型の発行が見られたものの、案件数は膨らまず落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/8/26	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	▲ 0.047				-	▲ 0.083	▲ 0.280	▲ 0.040	20,261.04	▲ 449.87	104.84-86	105.73-75
T/N							-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.035				-	▲ 0.088						
3W			0.000				-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.164	▲ 0.124						
6M							▲ 0.257	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.278	▲ 0.164						
									日付	8/19	8/20	8/21	8/22	8/23
									日銀当預残	4,032,100	4,027,600	4,013,600	4,016,800	4,017,700
									準備預金残	3,503,200	3,478,100	3,470,800	3,478,100	3,496,900
									マネタリーベース	5,154,400	5,149,500	5,135,400	5,139,700	5,141,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.061%	▲ 0.059%	▲ 0.058%	▲ 0.058%	▲ 0.052%
									コール市場残高	111,873	110,445	107,001	117,145	112,205
									うち無担	90,233	88,403	87,411	95,078	91,899
									うちO/N	58,683	56,773	54,191	61,333	57,854
									うち有担	21,640	22,042	19,590	22,067	20,306

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	応募総額(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10年超25年以下)	1,600	2019/8/27			6,270	1,604	▲0.038		▲0.034	51.4
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/8/27			1,428	401	▲0.045		▲0.043	46.2
国債買入(物価連動債)	250	2019/8/27			1,350	251	0.000		▲0.119	43.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/26	2019/8/27	▲ 0.350	39	39		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年8月27日の予定

*7月の企業向けサービス価格指数	*米国6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(5,000億円、8/28発行)
	*米国8月のCB消費者信頼感指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、9/4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