

Central Daily Market Report

2019年8月27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27日 需給速報	2019年8月28日 需給予想	2019年8月29日 当社予想
銀行券	100	0	▲ 1,000
財政	900	▲ 7,800	▲ 2,000
資金過不足	1,000	▲ 7,800	▲ 3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		2,500	
国債買入	2,700		
CP等買入		▲ 200	▲ 400
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	600	100	
国債補完供給			
当預増減	4,100	▲ 5,600	▲ 3,000
当座預金残高	4,041,600	4,036,000	4,033,000
準備預金残高	3,514,300		
積み終了先	3,513,600		
超過準備	3,513,600		
非準備預金先	527,300		
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	99.82%	日数
			38.71%

●2019年8月27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。引き続き調達ニーズが強く、本日も前日比でレートが若干上昇した。出合いのレンジは▲0.075~▲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(8/28-8/29)は、▲0.090~▲0.080%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2,500億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.009%、按分落札利回較差+0.008%と、在庫調整の売りから弱めの結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.162~▲0.1575%、6M物が▲0.255%、1Y物が▲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2,000億円弱に対して、発行総額は2,500億円弱と発行超であった。複数業態から発行が見られ比較的活況なマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。CP等買入オペアが3,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート0.002%・按分レート▲0.001%と、前回(平均▲0.001%・按分▲0.001%)比で平均レートが上昇した。

●短期金融市場関連指標

2019/8/27	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.085	▲ 0.270	0.010	20,456.08	195.04	105.96-97	105.73-75
T/N							-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.029				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.092						
3W			0.000				-	▲ 0.097						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.160	▲ 0.125						
6M							▲ 0.255	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.275	▲ 0.164						
									日付	8/20	8/21	8/22	8/23	8/26
									日銀当預残	4,027,600	4,013,600	4,016,800	4,017,700	4,037,500
									準備預金残	3,478,100	3,470,800	3,478,100	3,496,900	3,512,600
									マネタリーベース	5,149,500	5,135,400	5,139,700	5,141,100	5,160,400
									無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.058%	▲0.058%	▲0.052%	▲0.047%
									コール市場残高	110,445	107,001	117,145	112,205	110,077
									うち無担	88,403	87,411	95,078	91,899	89,884
									うちO/N	56,773	54,191	61,333	57,854	55,419
									うち有担	22,042	19,590	22,067	20,306	20,193

●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	292	-	5,000	2019/8/28		13,212.0	4,981.0		0.0320%	94.6817%		0.0300%	
交付税特会	-	-	10,500	2019/9/4	2020/3/4	273,687.0	10,500.11		0.0000%	3.8366%		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	2,500	2019/8/28			8,242	2,502	0.008		0.009	59.6
CP等買入	3,000	2019/8/30			7,955	2,981	▲0.001		0.002	45.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/27	2019/8/28	▲ 0.350	34	34		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/8/29	2019/9/6	2.630	0	0				

●2019年8月28日の予定

特にありません。

◆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