

# Central Daily Market Report

2019年8月29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29日		2019年8月30日		2019年9月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		300		1,000	
財政	▲ 1,400		1,200		▲ 33,000	
資金過不足	▲ 2,000		1,500		▲ 32,000	
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						▲ 2,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300	3,000	▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
E T F 買入	600					
国債補完供給	▲ 300	200		300		
当預増減	▲ 1,800		3,800		▲ 34,300	
当座預金残高	4,034,600		4,038,400		4,004,100	
準備預金残高	3,507,600					
積み終了先	3,507,200					
超過準備	3,506,600				8月30日以降の残り所要積立額 積数 4,000	
非準備預金先	527,000				1日平均 200	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額						3,178,500
準備預金進捗率	実績	99.87%	日数	45.16%		

## ●2019年8月29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~▲0.04%のレンジで調達が始まった。昨日の加重平均レートの低下を受け、調達サイドが慎重になったことからレートが低下した。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(8/30-9/2)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2Y402~403、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、月末要因もあってか小幅低下した。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で、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額500億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と大きく発行超であった。食料品・石油業態において大型発行が見られ、月初の発行としては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。

## ●短期金融市場関連指標

2019/8/29	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.086	▲ 0.290	▲ 0.015	20,460.93	▲ 18.49	106.08-10	106.10-11
T/N							-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.037				-	▲ 0.090						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.105						
3M			0.001				▲ 0.165	▲ 0.129						
6M							▲ 0.270	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.275	▲ 0.168						
									日付	8/22	8/23	8/26	8/27	8/28
									日銀当預残	4,016,800	4,017,700	4,037,500	4,041,600	4,036,400
									準備預金残	3,478,100	3,496,900	3,512,600	3,514,300	3,510,200
									マネタリーベース	5,139,700	5,141,100	5,160,400	5,164,500	5,159,300
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.052%	▲0.047%	▲0.041%	▲0.043%
									コール市場残高	117,145	112,205	110,077	110,257	115,783
									うち無担	95,078	91,899	89,884	90,565	95,440
									うちO/N	61,333	57,854	55,419	55,620	59,665
									うち有担	22,067	20,306	20,193	19,692	20,343

## ●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	棄分率	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)
2年利付国債	404	0.10%	20,000	2019/9/2	2021/9/1	88,328.0	16,345.00	100.8250	▲0.3090%	92.3256%	100.8290	▲0.3110%	3,651.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/9/6	2020/3/6	281,466.0	10,500.23		0.0000%	3.7306%		0.0000%	

## ●オペ結果

種類	オフター額(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(午前オフター分)		2019/8/29	2019/8/30	▲0.350	250	250		▲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・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	本則第37回	2019/9/3		1,934	36
成長基盤強化	ABL等特別第33期	2019/9/4		34	1
成長基盤強化	小口特別第30期	2019/9/3		6.03	8
成長基盤強化	米ドル特別第29期	2019/9/5		723	13
成長基盤強化	米ドル特別第25期(借り換え)	2019/9/5		1,297	15
成長基盤強化	米ドル特別第21期(借り換え)	2019/9/5		1,593	23
成長基盤強化	米ドル特別第17期(借り換え)	2019/9/5		3,588	25

## ●2019年8月30日の予定

*7月の完全失業率(市場予想:2.4%)	*7月の有効求人倍率(市場予想:1.61倍)	*米国7月の個人所得・消費支出
*8月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.7%)	*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.3%)	*米国8月のシカゴPM景況感指数
*7月の商業動態統計速報	*7月の住宅着工統計	*ユーロ圏8月の消費者物価指数速報
*月例経済報告		*国庫短期証券(854回)入札(3ヶ月、42,800億円、9/2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