

# Central Daily Market Report

2019年8月30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30日		2019年9月2日		2019年9月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		900		0	
財政	▲ 300		▲ 32,000		▲ 14,000	
資金過不足	▲ 100		▲ 31,100		▲ 14,000	
<b>金融調節</b>						
	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			2,200	▲ 2,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,400			
CP等買入	3,000	▲ 800		▲ 100		
貸出支援基金(成)					1,900	▲ 5,500
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200		▲ 100		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	1,900		▲ 18,700		▲ 17,600	
当座預金残高	4,036,500		4,017,800		4,000,200	
準備預金残高	3,511,800					
積み終了先	3,511,500				9月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,511,400				積数 3,000	
非準備預金先	524,700				1日平均 200	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					3,179,800	
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	54.84%		

## ●2019年8月30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▲0.07~▲0.045%のレンジで調達が始まった。このところのレート低下地合いに加え、月末要因が重なったことで調達ニーズが弱まり、レートは一段と低下した。出会いのレンジは▲0.086~▲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(9/2-9/3)は、▲0.120~▲0.080%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、低下した。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▲0.180%から▲0.185%まで買い進まれる展開となったものの、平均落札利回▲0.1731%、按分落札利回▲0.1623%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、▲0.174%と一時強めの出会いが見られたものの、その後は▲0.168~▲0.165%出会いと按分レート近辺で推移した。この他に、1Y物が▲0.285~▲0.280%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還が無かったものの発行総額は2,000億円程度まで膨らんだ。卸売・石油業態において大型発行が見られ、案件は少ないものの、月初旬の発行としては発行量が多めであった。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

2019/8/30	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.061				-	▲ 0.085	▲ 0.280	0.010	20,704.37	243.44	106.45-47	106.51-52
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.036				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.036				-	▲ 0.092						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.168	▲ 0.131						
6M							▲ 0.290	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.285	▲ 0.168						
									日付	8/23	8/26	8/27	8/28	8/29
									日銀当預残	4,017,700	4,037,500	4,041,600	4,036,400	4,034,600
									準備預金残	3,496,900	3,512,600	3,514,300	3,510,200	3,507,600
									マネタリーベース	5,141,100	5,160,400	5,164,500	5,159,300	5,158,100
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.047%	▲0.041%	▲0.043%	▲0.050%
									コール市場残高	112,205	110,077	110,257	115,783	117,153
									うち無担	91,899	89,884	90,565	95,440	98,505
									うちO/N	57,854	55,419	55,620	59,665	62,200
									うち有担	20,306	20,193	19,692	20,343	18,648

## ●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)
国庫短期証券	854	-	42,800	2019/9/2	2019/12/2	111,433.0	35,044.7	100.0405	▲0.1623%	94.1346%	100.0432	▲0.1731%	7,755.0

## ●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	2019/9/2	2019/9/17		2,219	2,219				
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/9/2			1,257	501	0.011		0.013	43.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2019/9/2			19,246	4,003	0.009		0.010	72.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,600	2019/9/2			9,370	3,605	0.005		0.006	44.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2019/9/2			11,391	4,003	0.016		0.017	98.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/30	2019/9/2	▲ 0.350	254	254		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年9月2日の予定

\*4-6月期の法人企業統計調査季報

\*New York祝日(Labor Day)

◆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