

Central Daily Market Report

2019年8月9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9日		2019年8月13日		2019年8月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		100		0	
財政	▲ 6,000		2,900		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 6,900		3,000		▲ 1,000	
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			600	▲ 700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,000			
CP等買入	2,500	▲ 100		▲ 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			
国債補完供給	▲ 100	400		100		
当預増減	▲ 4,200		13,200		▲ 1,000	
当座預金残高	3,962,600		3,975,800		3,974,800	
準備預金残高	3,446,400					
積み終了先	3,446,200				8月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,446,200				積数	
非準備預金先	516,200				1日平均	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,187,400	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	90.32%		

●2019年8月9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▲0.03~▲0.02%での調達で始まった。積み終盤の取り調整の動きに加え、週末要因も重なったことでレート水準は上昇した。一巡後は▲0.03%近辺での出合いが散見される程度で、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オペは15,000億円(8/13~8/26)オファーされ、応募額605億円(期落ち分655億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GCT/N(8/13-8/14)は、▲0.095~▲0.06%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10Y336~355、5Y136~140、30Y59~62、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。アウトライ市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.100%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.0989%、按分落札利回▲0.0932%と前回債からレートが上昇する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.104~▲0.095%出合いと堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.215~▲0.205%で、1Y物が▲0.215~▲0.205%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は、小売業態で大型発行があり、償還総額700億円程度に対して発行総額は1,000億円程度と発行超のマーケットとなった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/8/9	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考総計値	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	▲ 0.029				-	▲ 0.078	▲ 0.223	▲ 0.028	20,684.82	91.47	105.88-89	105.94-96
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.025	▲ 0.005	▲ 0.023				-	▲ 0.080						
3W							-	▲ 0.089						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.108	▲ 0.106						
6M							▲ 0.214	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.220	▲ 0.160						
									日付	8/2	8/5	8/6	8/7	8/8
									日銀当預残	3,958,800	3,960,300	3,965,500	3,964,600	3,966,800
									準備預金残	3,461,000	3,467,300	3,458,700	3,447,600	3,455,400
									マネタリーベース	5,082,300	5,083,100	5,087,900	5,087,100	5,090,300
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.050%	▲0.031%	▲0.032%	▲0.033%
									コール市場残高	102,700	99,331	97,646	110,132	99,919
									うち無担	82,598	79,654	79,373	90,552	81,895
									うちO/N	50,098	47,084	46,113	57,712	52,645
									うち有担	20,102	19,677	18,273	19,580	18,024

●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	850	-	42,800	2019/8/13	2019/11/11	126,502.2	35,142.6	100.0230	▲0.0932%	60.0184%	100.0244	▲0.0989%	7,657.0
エネルギー対策	-	-	6,500	2019/8/20	2020/8/20	135,793.0	6,499.88		0.0000%	4.7867%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/8/13	2019/8/26		605	605				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2019/8/13			9,676	4,001	▲0.017		▲0.014	69.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,600	2019/8/13			11,439	3,604	▲0.009		▲0.008	10.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,600	2019/8/13			3,456	1,602	▲0.012		▲0.008	39.6
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/8/13			1,568	403	▲0.014		▲0.010	28.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/9	2019/8/13	▲0.350	74	74		▲0.350	▲0.350	

●2019年8月12日の予定

*米国7月の財政収支

●2019年8月13日の予定

*6月の第3次産業活動指数
*7月の企業物価指数

*米国7月の消費者物価指数

◆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