

# Central Daily Market Report

2019年8月14日(水)

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14日		2019年8月15日		2019年8月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700	▲ 800				0
財政	▲ 5,300	76,600	▲ 24,000			
資金過不足	▲ 4,600	75,800	▲ 24,000			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 300	▲ 300			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入	100					
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 4,700	80,500	▲ 24,000			
当座預金残高	3,971,200	4,051,700	4,027,700			
準備預金残高	3,452,200					
積み終了先	3,452,100			8月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,452,000			積数	0	
非準備預金先	519,000			1日平均	0	
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	100.00%	日数	96.77%		

## ●2019年8月14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~▲0.01%での調達で始まった。積み最終日を前に引き続き調達意欲は強く、一巡後も▲0.02%近辺での出合いが見られた。ターム物に関しては、来積み期スタートのショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが散見された。

### <レポ市場>

GCT/N(8/15-8/16)は、▲0.105~▲0.09%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、30Y59~62、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、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5,000億円(前回と同額)でオファーされた。平均落札利回較差+0.008%、按分落札利回較差+0.003%と、在庫調整の売りからか小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.117~▲0.116%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、ノンバンク業態を中心に小玉の発行が見られ、償還総額250億円程度に対して、発行総額は200億円程度とほぼトントンとなった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/8/14	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	▲ 0.019				-	▲ 0.102	▲ 0.225	0.015	20,655.13	199.69	106.60-61	106.44-45
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.104						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.015	▲ 0.028				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.105						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.117	▲ 0.117						
6M							▲ 0.222	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.225	▲ 0.162						
									日付	8/6	8/7	8/8	8/9	8/13
									日銀当預残	3,965,500	3,964,600	3,966,800	3,962,600	3,975,900
									準備預金残	3,458,700	3,447,600	3,455,400	3,446,400	3,460,600
									マネタリーベース	5,087,900	5,087,100	5,090,300	5,087,000	5,100,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.031%	▲ 0.032%	▲ 0.033%	▲ 0.029%	▲ 0.025%
									コール市場残高	97,646	110,132	99,919	104,732	104,106
									うち無担	79,373	90,552	81,895	86,746	86,286
									うちO/N	46,113	57,712	52,645	56,856	56,886
									うち有担	18,273	19,580	18,024	17,986	17,820

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/8/22	2020/2/19	273,753.0	10,500.05		0.0000%	3.8357%		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	5,000	2019/8/15			10,734	5,001	0.003		0.008	34.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/14	2019/8/15	-0.35	1	1		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年8月15日の予定

\*米国6月の企業在庫  
\*米国7月の小売売上高  
\*米国7月の鉱工業生産・設備稼働率

\*5年利付国債入札  
(19,000億円、8/16発行)

◆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