

# Central Daily Market Report

2019年8月28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28日		2019年8月29日		2019年8月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 600		▲ 800	
財政	▲ 7,200		▲ 300		2,000	
資金過不足	▲ 7,200		▲ 900		1,200	
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	2,500					
国債買入						
CP等買入		▲ 400		▲ 300	3,000	
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	100		600			
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	▲ 5,200		▲ 400		4,200	
当座預金残高	4,036,400		4,036,000		4,040,200	
準備預金残高	3,510,200					
積み終了先	3,509,500		8月29日以降の残り所要積立額		積数 4,900	
超過準備	3,509,500		1日平均		300	
非準備預金先	526,200					
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	99.85%	日数	41.94%		

## ●2019年8月28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▲0.055~▲0.035%のレンジで調達が始まった。朝方は引き続き調達ニーズが強く、▲0.035%でまとまった出合いが見られた。ただ、取りあがる先は限定的であったため、一巡後はやや落ち着いた展開となった。出合いのレンジは▲0.075~▲0.03%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(8/29-8/30)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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.169~▲0.160%、6M物が▲0.270~▲0.260%、1Y物が▲0.275%出合いと堅調に推移した。

### <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1兆2,000億円弱に対して、発行総額は1兆円弱と大きく償還超であった。発行日が月末となったことで、幅広い業態において大型発行案件が数多く見られ、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

2019/8/28	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.084	▲ 0.275	▲ 0.005	20,479.42	23.34	105.74-76	105.73-75
T/N			0.001				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.037				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.035	▲ 0.018	▲ 0.021				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.097						
1M	0.015	0.030	0.024				-	▲ 0.106						
3M			▲ 0.033				▲ 0.165	▲ 0.126						
6M							▲ 0.270	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.275	▲ 0.165						
									日付	8/21	8/22	8/23	8/26	8/27
									日銀当預残	4,013,600	4,016,800	4,017,700	4,037,500	4,041,600
									準備預金残	3,470,800	3,478,100	3,496,900	3,512,600	3,514,300
									マネタリーベース	5,135,400	5,139,700	5,141,100	5,160,400	5,164,500
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.058%	▲0.052%	▲0.047%	▲0.041%
									コール市場残高	107,001	117,145	112,205	110,077	110,257
									うち無担	87,411	95,078	91,899	89,884	90,565
									うちO/N	54,191	61,333	57,854	55,419	55,620
									うち有担	19,590	22,067	20,306	20,193	19,692

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/28	2019/8/29	▲ 0.350	124	124		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/8/28	2019/8/29	▲ 0.350	37	37		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年8月29日の予定

*鈴木日銀審議委員、熊本県金融経済懇談会において講演	*米国4-6月期のGDP改定値	*2年利付国債入札(20,000億円、9/2発行)
*7月の消費動向調査		*交付税特別会計借入(10,500億円、9/6借入)

◆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