

Central Daily Market Report

2019年8月1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1日		2019年8月2日		2019年8月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 100		1,000	
財政	▲ 28,000		▲ 84,500		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 28,400		▲ 84,600		▲ 5,000	
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						▲ 2,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	2,500					
国債買入	12,700					
CP等買入				▲ 100		
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						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当預増減	▲ 13,000		▲ 84,600		▲ 7,400	
当座預金残高	4,046,500		3,961,900		3,954,500	
準備預金残高	3,542,000					
積み終了先	3,541,300					
超過準備	3,541,100					
非準備預金先	504,500					
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,186,400	
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	54.84%		

●2019年8月1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▲0.075~▲0.06%での調達で始まった。一巡後は▲0.07%近辺の出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた、ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(8/2-8/5)は、▲0.070~▲0.065%程度の出合い。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、30Y59~63、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は横ばい圏での推移。CP発行市場は、償還総額1,200億円程度に対して、発行総額1,500億円程度となり、石油・鉄鋼業態等からまとまったロットでの発行が見られた。発行レートは引き続き0%付近での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2019/8/1	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.070				-	▲ 0.065	▲ 0.135	0.025	21,540.99	19.46	108.82-83	109.14-15
T/N							-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.045				-	▲ 0.071						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.016				-	▲ 0.076						
3W			0.000				-	▲ 0.084						
1M	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.024				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.123	▲ 0.113						
6M							▲ 0.255	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.160						
									日付	7/25	7/26	7/29	7/30	7/31
									日銀当預残	4,046,900	4,046,200	4,055,800	4,054,100	4,059,500
									準備預金残	3,520,500	3,534,900	3,559,400	3,556,500	3,546,700
									マネタリーベース	5,169,600	5,169,800	5,179,200	5,177,500	5,182,600
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.073%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.071%
									コール市場残高	111,818	111,901	110,345	102,309	104,983
									うち無担	89,602	90,685	87,534	81,160	82,674
									うちO/N	56,737	57,120	51,629	47,705	50,064
									うち有担	22,216	21,216	22,811	21,149	22,309

●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)
10年利付国債	355	0.10%	21,000	2019/8/2	2029/6/20	64,365.0	17,111.00	102.5100	▲0.1500%	1.7771%	102.5300	▲0.1520%	3,877.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/1	2019/8/2	▲ 0.350	56	56		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年8月2日の予定

*7月実績/8月見込み財政資金対民間収支	*米国6月の貿易収支	*国庫短期証券(848回)入札(3ヶ月、42,700億円、8/5発行)
*金融政策決定会合議事要旨(6月19、20日分)	*米国6月の製造業新規受注・出荷・在庫	*交付税特別会計借入(10,500億円、8/14借入)
*7月のマネタリーベース	*米国7月の雇用統計	

◆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