

Central Daily Market Report

2019年8月5日(月)

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5日 需給速報	2019年8月6日 需給予想	2019年8月7日 当社予想
銀行券	600	300	0
財政	▲ 2,000	800	▲ 8,000
資金過不足	▲ 1,400	1,100	▲ 8,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	2,300	▲ 2,400	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	3,200	6,500	
CP等買入		▲ 200	
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			
国債補完供給		100	
当預増減	1,500	7,600	▲ 8,000
当座預金残高	3,960,300	3,967,900	3,959,900
準備預金残高	3,467,300		
積み終了先	3,467,100		
超過準備	3,467,100		
非準備預金先	493,000		
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	99.95%	日数
			67.74%

●2019年8月5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~▲0.04%での調達で始まった。積み期後半に差し掛かり、着地に向けた取り調整に動く先が多く見られ、先週末よりも調達レートが大幅に上昇した。一巡後も▲0.05%近辺での出合いが見られた。ターム物に関しては、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(8/6-8/7)は、▲0.03~▲0.01%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、上昇した。アウトライト市場は、店頭での買いが入ったことでもあってか、3M物が▲0.108~▲0.100%で出合った。また、1Y物が▲0.203%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、案件は少なかったものの自動車・その他金融業態でまとまった調達があり、発行総額は1,200億円程度となった。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

2019/8/5	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.120	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.030	▲ 0.199	▲ 0.029	20,720.29	▲ 366.87	106.56-58	105.94-95	
T/N							-	▲ 0.025							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.035							
2W							-	▲ 0.043							
3W							-	▲ 0.061							
1M							-	▲ 0.076							
3M								▲ 0.108	▲ 0.104						
6M								▲ 0.255	▲ 0.149						
1Y								▲ 0.203	▲ 0.160						
										日付	7/29	7/30	7/31	8/1	8/2
										日銀当預残	4,055,800	4,054,100	4,059,500	4,046,500	3,958,800
										準備預金残	3,559,400	3,556,500	3,546,700	3,542,000	3,461,000
										マネタリーベース	5,179,200	5,177,500	5,182,600	5,169,900	5,082,300
										無担O/N加重平均	▲ 0.072%	▲ 0.071%	▲ 0.071%	▲ 0.070%	▲ 0.063%
										コール市場残高	110,345	102,309	104,983	113,590	102,700
										うち無担	87,534	81,160	82,674	91,366	82,598
										うちO/N	51,629	47,705	50,064	58,326	50,098
										うち有担	22,811	21,149	22,309	22,224	20,102

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/8/6			1,277	501	0.006		0.013	6.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/8/6			12,324	4,808	▲ 0.029		▲ 0.026	69.2
国債買入(変動利付債)	1,000	2019/8/6			2,887	1,003	▲ 0.190		▲ 0.202	47.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/5	2019/8/6	▲ 0.250	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/8/5	2019/8/6	▲ 0.250	0	0				

●2019年8月6日の予定

*6月の毎月勤労統計調査速報	*30年利付国債入札
*6月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+1.4%)	(7,000億円、8/7発行)
*6月の景気動向指数速報	

◆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