

Central Daily Market Report

2019年8月6日(火)

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6日 需給速報	2019年8月7日 需給予想	2019年8月8日 当社予想
銀行券	400	▲ 200	0
財政	▲ 1,600	▲ 5,400	▲ 2,000
資金過不足	▲ 1,200	▲ 5,600	▲ 2,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証券買入		5,000	
国債買入	6,500		
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		100	
国債補完供給	▲ 100		100
当預増減	5,200	▲ 500	▲ 2,000
当座預金残高	3,965,500	3,965,000	3,963,000
準備預金残高	3,458,700		
積み終了先	3,458,500		
超過準備	3,458,500		
非準備預金先	506,800		
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
			70.97%

●2019年8月6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▲0.035~▲0.02%での調達が始まった。昨日に続き調達ニーズは強く、一巡後も▲0.03%近辺での出合いが見られた。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>

GCT/N(8/7-8/8)は、▲0.06~▲0.03%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、30Y59~63、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、レートが低下した。アウトライト市場では、短国買入オベが5,000億円(前回比+2,500億円)でオファーされた。応札額が14,752億円と多く、平均落札利回較差+0.010%、按分落札利回較差+0.008%と、在庫調整の売りから弱めの結果となった。マーケットでも、3M物が▲0.105~▲0.101%出合いと軟調に推移した。

<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、発行・償還総額共に800億円程度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。本日はCP等買入オベがオファー額2,500億円を実施された。入札結果は平均・按分落札レートともに▲0.001%となり、前回比(平均0.003%・按分▲0.001%)で平均レートが低下した。

●短期金融市場関連指標

2019/8/6	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.031				-	▲ 0.038	▲ 0.185	0.014	20,585.31	▲ 134.98	105.61-62	106.37-38
T/N							-	▲ 0.039						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.042						
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.013				-	▲ 0.049						
3W			0.000				-	▲ 0.065						
1M							-	▲ 0.080						
3M			0.060				▲ 0.102	▲ 0.105						
6M							▲ 0.255	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.160						
									日付	7/30	7/31	8/1	8/2	8/5
									日銀当預残	4,054,100	4,059,500	4,046,500	3,958,800	3,960,300
									準備預金残	3,556,500	3,546,700	3,542,000	3,461,000	3,467,300
									マネタリーベース	5,177,500	5,182,600	5,169,900	5,082,300	5,083,100
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.071%	▲0.070%	▲0.063%	▲0.050%
									コール市場残高	102,309	104,983	113,590	102,700	99,331
									うち無担	81,160	82,674	91,366	82,598	79,654
									うちO/N	47,705	50,064	58,326	50,098	47,084
									うち有担	21,149	22,309	22,224	20,102	19,677

●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)
30年利付国債	63	0.40%	7,000	2019/8/7	2049/6/20	20,175.0	5,766.00	102.7500	0.2990%	81.5080%	102.9500	0.2920%	1,227.0

●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
国庫短期証券買入	5,000	2019/8/7			14,752	5,001	0.008		0.010	87.3
CP等買入	2,500	2019/8/9			6,622	2,480	▲0.001		▲0.001	76.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/6	2019/8/7	▲ 0.250	50	50		▲ 0.250	▲ 0.250	
米ドル資金供給		2019/8/8	2019/8/15	2.620	1	1				

●2019年8月7日の予定

*決定会合における主な意見(7月29、30日分)
*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引

*米国6月の消費者信用残高

◆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