

Central Daily Market Report

2019年8月7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7日		2019年8月8日		2019年8月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 1,000		▲ 1,000	
財政	▲ 5,900		2,300		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 6,000		1,300		▲ 8,000	
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		▲ 100		▲ 200		2,500
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		200			
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 900		1,300		▲ 5,500	
当座預金残高	3,964,600		3,965,900		3,960,400	
準備預金残高	3,447,500					
積み終了先	3,447,300				8月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,447,300				積数 1,200	
非準備預金先	517,100				1日平均 100	
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	99.96%	日数	74.19%		

●2019年8月7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▲0.04~▲0.03%での調達で始まった。GCLレポレートの上昇が一服したこともあり、昨日よりもやや弱めの地合いとなった。一巡後はビッドが薄くなり、▲0.05%近辺で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>

GCT/N(8/8-8/9)は、▲0.075~▲0.035%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、30Y59~62、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、レートが低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.105%、1Y物が▲0.196~▲0.195%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、10日の前倒し発行に当たり鉄鋼・ゴム製品・不動産業態等で大型案件が実施された。償還総額2,100億円程度に対して発行総額は2,800億円程度と発行超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。

●短期金融市場関連指標

2019/8/7	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.039	▲ 0.200	▲ 0.015		20,516.56	▲ 68.75	106.32-33	106.29-30
T/N							-	▲ 0.049							
S/N							-	-							
1W				0.070			-	▲ 0.054							
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.019				-	▲ 0.065							
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.073							
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.087							
3M							▲ 0.105	▲ 0.103							
6M							▲ 0.251	▲ 0.150							
1Y							▲ 0.195	▲ 0.160							
									日付	7/31	8/1	8/2	8/5	8/6	
									日銀当預残	4,059,500	4,046,500	3,958,800	3,960,300	3,965,500	
									準備預金残	3,546,700	3,542,000	3,461,000	3,467,300	3,458,700	
									マネタリーベース	5,182,600	5,169,900	5,082,300	5,083,100	5,087,900	
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.070%	▲0.063%	▲0.050%	▲0.031%	
									コール市場残高	104,983	113,590	102,700	99,331	97,646	
									うち無担	82,674	91,366	82,598	79,654	79,373	
									うちO/N	50,064	58,326	50,098	47,084	46,113	
									うち有担	22,309	22,224	20,102	19,677	18,273	

●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)		2019/8/7	2019/8/8	▲ 0.250	7	7		▲ 0.250	▲ 0.250	

●2019年8月8日の予定

*6月の国際収支	*米国6月の米卸売売上高	*国庫短期証券(849回)入札 (6ヶ月、23,000億円、8/13発行)
*6月の特定サービス産業動態統計速報		*10年物価連動国債入札 (4,000億円、8/9発行)
*7月の景気ウォッチャー調査		

◆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