

# Central Daily Market Report

2019年8月8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8日		2019年8月9日		2019年8月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,000		1,000	
財政	3,600		▲ 6,500		▲ 3,000	
資金過不足	2,600		▲ 7,500		▲ 2,000	
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						▲ 700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200	2,500	▲ 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	200					
国債補完供給	▲ 400			400		
当預増減	2,200		▲ 4,700		▲ 2,700	
当座預金残高	3,966,800		3,962,100		3,959,400	
準備預金残高	3,455,300					
積み終了先	3,455,100				8月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,455,100				積数 1,000	
非準備預金先	511,500				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	99.97%	日数	77.42%		

## ●2019年8月8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。一巡後は▲0.05%近辺での出会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、目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(8/9-8/13)は、▲0.08~▲0.065%程度での出会い。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、小幅低下。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.210~▲0.200%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.1934%、按分落札利回▲0.1873%とWI取引ほどの強さは見られない結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.210~▲0.205%と一時強めの出会いが見られたものの、その後は閑散で、引け際に▲0.196%で出合った程度だった。この他に、3M物が▲0.108~▲0.105%で、1Y物が▲0.200%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、償還総額300億円程度に対して発行総額は600億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

2019/8/8	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.044	▲ 0.195	0.005	20,593.35	76.79	106.10-12	106.10-11
T/N							-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.088						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.103	▲ 0.106						
6M							▲ 0.205	▲ 0.151						
1Y			0.100				▲ 0.200	▲ 0.160						
									日付	8/1	8/2	8/5	8/6	8/7
									日銀当預残	4,046,500	3,958,800	3,960,300	3,965,500	3,964,600
									準備預金残	3,542,000	3,461,000	3,467,300	3,458,700	3,447,600
									マネタリーベース	5,169,900	5,082,300	5,083,100	5,087,900	5,087,100
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.063%	▲0.050%	▲0.031%	▲0.032%
									コール市場残高	113,590	102,700	99,331	97,646	110,132
									うち無担	91,366	82,598	79,654	79,373	90,552
									うちO/N	58,326	50,098	47,084	46,113	57,712
									うち有担	22,224	20,102	19,677	18,273	19,580

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
国庫短期証券	849	-	23,000	2019/8/13	2020/2/10	89,046.0	18,858.7	100.0930	▲0.1873%	59.0632%	100.0960	▲0.1934%	4,141.0
物価連動10年	24	0.10%	4,000	2019/8/9	2029/3/10	15,347.0	3,996.0	104.2500	▲0.3290%	86.6906%			

## ●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)		2019/8/8	2019/8/9	▲0.250	331	331		▲0.250	▲0.250	

## ●2019年8月9日の予定

\*4-6月期のGDP1次速報  
市場予想：前期比年率+0.4%  
\*7月のマネーストック

\*米国7月の生産者物価指数  
\*英国4-6月期のGDP速報値

\*国庫短期証券(850回)入札  
(3ヶ月、42,800億円、8/13発行)  
\*エネルギー対策借入  
(6,500億円、8/20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お客様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