

Central Daily Market Report

2019年8月2日(金)

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2日		2019年8月5日		2019年8月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		600		0	
財政	▲ 87,600		▲ 4,900		2,000	
資金過不足	▲ 87,600		▲ 4,300		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			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			
CP等買入		▲ 100		▲ 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	100		100		
当預増減	▲ 87,700		▲ 1,400		2,000	
当座預金残高	3,958,800		3,957,400		3,959,400	
準備預金残高	3,461,000					
積み終了先	3,460,800					
超過準備	3,460,700				8月5日以降の残り所要積立額 積数 1,900	
非準備預金先	497,800				1日平均 200	
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		99.94%		日数 64.52%	

●2019年8月2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▲0.07~▲0.05%での調達で始まった。税揚げ要因により大幅な不足日であったこともあり、昨日よりもやや調達レートが上昇した。一巡後は▲0.07%近辺での出会いが散見される程度で、今週の取引を終えた。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>

GC T/N(8/5-8/6)は、▲0.070~▲0.025%程度のお合い。後場から引けにかけて急速にレートを切り上げた。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、発行日要因もあって上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.124~▲0.120%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.1154%、按分落札利回▲0.1070%と前回債からレートが上昇し、テールも流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでも、▲0.107~▲0.099%お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、償還も限定的であったため、商社からまとまった発行が見られた程度で閑散。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

2019/8/2	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.062	▲ 0.170	▲ 0.035	21,087.16	▲ 453.83	107.44-45	106.91-92
T/N							-	▲ 0.059						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.041				-	▲ 0.062						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.029				-	▲ 0.068						
3W			0.000				-	▲ 0.078						
1M							-	▲ 0.088						
3M							▲ 0.099	▲ 0.110						
6M							▲ 0.255	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.160						
									日付	7/26	7/29	7/30	7/31	8/1
									日銀当預残	4,046,200	4,055,800	4,054,100	4,059,500	4,046,500
									準備預金残	3,534,900	3,559,400	3,556,500	3,546,700	3,542,000
									マネタリーベース	5,169,800	5,179,200	5,177,500	5,182,600	5,169,900
									無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.070%
									コール市場残高	111,901	110,345	102,309	104,983	113,590
									うち無担	90,685	87,534	81,160	82,674	91,366
									うちO/N	57,120	51,629	47,705	50,064	58,326
									うち有担	21,216	22,811	21,149	22,309	22,224

●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)
国庫短期証券	848	-	42,700	2019/8/5	2019/11/5	116,313.0	34,948.5	100.0270	▲0.1070%	53.2890%	100.0291	▲0.1154%	7,751.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/8/14	2020/2/13	276,631.0	10,500.07		0.0000%	3.7958%		0.0000%	

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/8/5	2019/8/19		2,256	2,256				
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/8/5			5,457	1,813	▲0.037		▲0.034	13.3
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/8/5			1,724	400		▲0.036	▲0.036	
国債買入(物価連動債)	250	2019/8/5			1,267	251	0.080		0.055	64.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/8/2	2019/8/5	▲0.350	125	125		▲0.350	▲0.350	

●2019年8月5日の予定

*8月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国7月のISM非製造業景況指数
-------------------	-------------------

◆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