

# Central Daily Market Report

2019年7月1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7月1日		2019年7月2日		2019年7月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		800		0	
財政	▲ 25,700		▲ 5,100		▲ 50,000	
資金過不足	▲ 25,100		▲ 4,300		▲ 50,000	
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	▲ 600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,800					
CP等買入						
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			300			
国債補完供給						
当預増減	▲ 17,200		▲ 4,000		▲ 50,000	
当座預金残高	4,090,700		4,086,700		4,036,700	
準備預金残高	3,584,200					
積み終了先	3,584,000				7月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,584,000				積数	
非準備預金先	506,500				1日平均	
					200	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,083,000	
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	53.33%		

## ●2019年7月1日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、四半期末要因で調達を控えていた参加者が復活したため前営業日対比でレートが上昇したものの、全体的に資金調達需要が弱い状況に変わりは無く、早々にギブンされる展開となった。立ち上がりは邦銀、証券業態の調達を中心に▲0.08~▲0.02%の出会い。一巡後は▲0.08%台での出会いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(7/2-7/3)は、▲0.095~▲0.080%程度 of 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10Y336~354、5Y134~139、30Y59~62、40Y6~12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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.177~▲0.170%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、小売・卸売・鉄鋼業態等から大型案件が複数見られ、償還総額300億円程度に対して、発行総額は3,400億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね0%近辺で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/7/1	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
O/N	▲ 0.150	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.091	▲ 0.150	0.015	21,729.97	454.05	108.37-38	108.32-33
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.040	▲ 0.067				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.075	0.000	▲ 0.062				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.109	▲ 0.122						
6M							▲ 0.172	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.222	▲ 0.158						
									日付	6/24	6/25	6/26	6/27	6/28
									日銀当預残	4,103,100	4,106,900	4,101,200	4,110,700	4,107,900
									準備預金残	3,600,300	3,596,900	3,575,300	3,587,900	3,584,500
									マネタリーベース	5,223,400	5,228,200	5,223,800	5,235,600	5,233,700
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.066%	▲0.068%	▲0.070%	▲0.076%
									コール市場残高	115,952	123,032	121,536	127,686	77,040
									うち無担	93,555	99,155	94,762	96,207	55,487
									うちO/N	56,665	62,885	52,452	54,547	36,307
									うち有担	22,397	23,877	26,774	31,479	21,553

## ●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)	18,641	2019/7/1	2019/7/2		2	2		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年7月2日の予定

*6月実績/7月見込み財政資金対民間収支	*10年利付国債入札
*6月のマネタリーベース	(21,000億円、7/3発行)

◆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