

Central Daily Market Report

2019年7月2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7月2日		2019年7月3日		2019年7月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		400		0	
財政	▲ 9,000		▲ 45,700		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 8,400		▲ 45,300		▲ 1,000	
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			2,500			
国債買入						
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	▲ 8,100		▲ 42,800		▲ 1,000	
当座預金残高	4,082,600		4,039,800		4,038,800	
準備預金残高	3,567,900					
積み終了先	3,567,700		7月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,567,700		積数		2,600	
非準備預金先	514,700		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	99.92%	日数	56.67%		

●2019年7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、昨日に引き続き各業態の資金調達需要は弱く、低水準のレートでの取引が中心となった。立ち上がりは邦銀、証券業態の調達を中心に▲0.08~▲0.06%の出合い。一巡後は▲0.08~▲0.07%での出合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(7/3-7/4)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。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10Y336~354、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。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.017%、全取落札利回較差+0.016%と、在庫調整の売りから弱めの結果となった。マーケットでは、特段の出合いは見られなかった。

<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、案件少なく閑散としたマーケットとなり、発行総額は300億円程度にとどまった。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

2019/7/2	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.089	▲ 0.135	0.015	21,754.27	24.30	108.37-38	108.26-27
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.075	▲ 0.015	▲ 0.038				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.098						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.113	▲ 0.125						
6M							▲ 0.172	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.222	▲ 0.158						
									日付	6/25	6/26	6/27	6/28	7/1
									日銀当預残	4,106,900	4,101,200	4,110,700	4,107,900	4,090,700
									準備預金残	3,596,900	3,575,300	3,587,900	3,584,500	3,584,200
									マネタリーベース	5,228,200	5,223,800	5,235,600	5,233,700	5,215,900
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.068%	▲0.070%	▲0.076%	▲0.071%
									コール市場残高	123,032	121,536	127,686	77,040	105,183
									うち無担	99,155	94,762	96,207	55,487	83,488
									うちO/N	62,885	52,452	54,547	36,307	56,133
									うち有担	23,877	26,774	31,479	21,553	21,695

●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)
10年利付国債	355	0.10%	21,000	2019/7/3	2029/6/20	67,987.0	17,345.00	102.4000	▲0.1370%	93.8948%	102.4200	▲0.1390%	3,644.0

●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	2,500	2019/7/3			12,469	2,500		0.016	0.017	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	169,289	2019/7/2	2019/7/3		20	20		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/7/5	2019/7/11	2.87	0	0				

●2019年7月3日の予定

*布野日銀審議委員、広島県金融経済懇談会において講演
*7月の日銀当座預金増減要因見込み

*米国5月の貿易収支
*米国5月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国6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