

# Central Daily Market Report

2019年7月3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7月3日 需給速報	2019年7月4日 需給予想	2019年7月5日 当社予想
銀行券	300	▲ 700	0
財政	▲ 45,700	▲ 1,100	▲ 5,000
資金過不足	▲ 45,400	▲ 1,800	▲ 5,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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		10,400	
CP等買入		▲ 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			
国債補完供給	▲ 300	300	
当預増減	▲ 43,200	8,800	▲ 5,000
当座預金残高	4,039,400	4,048,200	4,043,200
準備預金残高	3,544,200		
積み終了先	3,543,900		
超過準備	3,543,900		
非準備預金先	495,200		
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	99.93%	日数
			60.00%

## ●2019年7月3日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、税揚げ日にあたり大幅な不足日となったが、引き続き各業態の資金調達意欲は弱く、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▲0.085~▲0.05%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、1W物のショートタームを中心に引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(7/4-7/5)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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に1Y物が▲0.215%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、案件数は少なかったものの鉄鋼・卸売・石油業態等で大型発行が実施され、償還総額900億円程度に対して、発行総額2,500億円程度と発行超のマーケットとなった。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

2019/7/3	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				-	▲ 0.083	▲ 0.160	▲ 0.025	21,638.16	▲ 116.11	107.83-84	107.74-75
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.070	▲ 0.010	▲ 0.032				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.113	▲ 0.124						
6M							▲ 0.172	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.215	▲ 0.158						
									日付	6/26	6/27	6/28	7/1	7/2
									日銀当預残	4,101,200	4,110,700	4,107,900	4,090,700	4,082,600
									準備預金残	3,575,300	3,587,900	3,584,500	3,584,200	3,568,000
									マネタリーベース	5,223,800	5,235,600	5,233,700	5,215,900	5,207,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.068%	▲ 0.070%	▲ 0.076%	▲ 0.071%	▲ 0.071%
									コール市場残高	121,536	127,686	77,040	105,183	107,479
									うち無担	94,762	96,207	55,487	83,488	84,423
									うちO/N	52,452	54,547	36,307	56,133	52,223
									うち有担	26,774	31,479	21,553	21,695	23,056

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,800	2019/7/4			14,435	3,807	▲0.005		▲0.004	56.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,800	2019/7/4			13,213	3,800	▲0.021		▲0.017	24.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/7/4			4,855	1,807	▲0.028		▲0.025	25.6
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/7/4			1,543	405	▲0.029		▲0.027	32.5
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	531,985	2019/7/3	2019/7/4		278	278		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年7月4日の予定

*New York祝日(Independence Day)	*30年利付国債入札(7,000億円、7/5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