

# Central Daily Market Report

2019年7月4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7月4日		2019年7月5日		2019年7月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		400		1,000	
財政	▲ 1,100		▲ 4,700		1,000	
資金過不足	▲ 1,800		▲ 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						▲ 3,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,400					
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 400	300		400		
当預増減	8,400		▲ 4,100		▲ 1,700	
当座預金残高	4,047,800		4,043,700		4,042,000	
準備預金残高	3,542,000					
積み終了先	3,541,700					
超過準備	3,541,700					7月5日以降の残り所要積立額 積数 2,000
非準備預金先	505,800					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	99.94%	日数	63.33%		

## ●2019年7月4日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き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▲0.086~▲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(7/5-7/6)は、▲0.090~▲0.080%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、翌日に3M物の入札を控えて動意なく閑散な中、引け際に3M物のWI取引で▲0.150~▲0.145%の出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は卸売業態から大型発行が見られ、償還総額800億円程度に対して、発行総額1,100億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

2019/7/4	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.082	▲ 0.160	0.000	21,702.45	64.29	107.77-78	107.80-82
T/N			▲ 0.065				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.025	▲ 0.040				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.113	▲ 0.124						
6M							▲ 0.175	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.215	▲ 0.159						
									日付	6/27	6/28	7/1	7/2	7/3
									日銀当預残	4,110,700	4,107,900	4,090,700	4,082,600	4,039,400
									準備預金残	3,587,900	3,584,500	3,584,200	3,568,000	3,544,300
									マネタリーベース	5,235,600	5,233,700	5,215,900	5,207,100	5,163,700
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.076%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.071%
									コール市場残高	127,686	77,040	105,183	107,479	108,156
									うち無担	96,207	55,487	83,488	84,423	84,305
									うちO/N	54,547	36,307	56,133	52,223	51,320
									うち有担	31,479	21,553	21,695	23,056	23,851

## ●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)	募入最低値	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)
30年利付国債	63	0.40%	7,000	2019/7/5	2049/6/20	23,042.0	5,745.00	101.0000	0.3620%	13.0239%	101.1500	0.3570%	1,248.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	253,198	2019/7/4	2019/7/5		58	58		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	32,779	2019/7/4	2019/7/5		337	337		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年7月5日の予定

*5月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+1.6%)	*米国6月の雇用統計	*国庫短期証券(842回)入札(3ヶ月、43,300億円、7/8発行)
*5月の景気動向指数速報		
*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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