

Central Daily Market Report

2019年7月5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7月5日		2019年7月8日		2019年7月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		1,200		0	
財政	▲ 5,300		8,200		4,000	
資金過不足	▲ 4,700		9,400		4,000	
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			2,600	▲ 3,700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			5,800			
CP等買入		▲ 200		▲ 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	▲ 700	400		700		
当預増減	▲ 5,200		14,700		4,000	
当座預金残高	4,042,600		4,057,300		4,061,300	
準備預金残高	3,537,200					
積み終了先	3,536,900					
超過準備	3,536,900				7月8日以降の残り所要積立額 積数 1,300	
非準備預金先	505,400				1日平均 200	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,088,800	
準備預金進捗率	実績 99.96%		日数 73.33%			

●2019年7月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末で3日積みの取引となる中、各業態の資金調達需要は減退し、一段と低い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~▲0.045%の出合い。一巡後は、ビッド数が減少し▲0.086~▲0.07%で散發的な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(7/8-7/9)は、▲0.120~▲0.095%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、低下した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。期越えの銘柄ということもあってか、WI取引において▲0.155%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.1455%、按分落札利回▲0.1323%とWI取引ほどの強さは見られない結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.139~▲0.135%出合いと按分レート近辺で推移した。

<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、償還総額350億円に対して、発行総額1,000億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

2019/7/5	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	▲ 0.074				-	▲ 0.097	▲ 0.170	▲ 0.010	21,746.38	43.93	107.82-83	108.05-06
T/N							-	▲ 0.113						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.000	▲ 0.055				-	▲ 0.108						
2W							-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.112						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.135	▲ 0.128						
6M							▲ 0.175	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.215	▲ 0.159						
									日付	6/28	7/1	7/2	7/3	7/4
									日銀当預残	4,107,900	4,090,700	4,082,600	4,039,400	4,047,800
									準備預金残	3,584,500	3,584,200	3,568,000	3,544,300	3,542,000
									マネタリーベース	5,233,700	5,215,900	5,207,100	5,163,700	5,172,800
									無担O/N加重平均	▲0.076%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.072%
									コール市場残高	77,040	105,183	107,479	108,156	113,608
									うち無担	55,487	83,488	84,423	84,305	90,145
									うちO/N	36,307	56,133	52,223	51,320	54,070
									うち有担	21,553	21,695	23,056	23,851	23,463

●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	842	-	43,300	2019/7/8	2019/10/7	112,902.5	35,732.7	100.0330	▲0.1323%	46.0477%	100.0363	▲0.1455%	7,567.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2019/7/8	2019/7/22		2,556	2,556				
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/7/8			2,092	500	0.023		0.026	78.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/7/8			15,880	4,814	▲0.012		▲0.010	43.7
国債買入(物価連動債)	250	2019/7/8			1,281	250		▲0.180	▲0.180	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	310,830	2019/7/5	2019/7/8		682	682		▲0.350	▲0.350	

●2019年7月8日の予定

*5月の機械受注統計	5月の米消費者信用残高
*5月の国際収支	
*6月の景気ウォッチャー調査	

◆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