

Central Daily Market Report

2019年7月8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8日		2019年7月9日		2019年7月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		400			0
財政	12,200		2,300			▲ 30,000
資金過不足	13,200		2,700			▲ 30,000
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		▲ 100		▲ 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	▲ 100	700		100		
当預増減	18,400		2,700			▲ 30,000
当座預金残高	4,061,000		4,063,700			4,033,700
準備預金残高	3,549,200					
積み終了先	3,548,900					
超過準備	3,548,900					
非準備預金先	511,800					
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	99.97%	日数	76.67%		

●2019年7月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、実質的な積み最終週となるものの、全体的に資金調達需要が乏しい状況に変化は無く、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~▲0.05%の出合い。一巡後は、▲0.086~▲0.07%のレンジ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(7/9-7/10)は、▲0.120~▲0.100%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、低水準で推移した。アウトライト市場は、翌日に6M物の入札を控えて動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は鉄鋼業態で大型案件が観測され、償還総額1,050億円程度に対して、発行総額は2,400億円程度と発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/7/8	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲ 0.075				-	▲ 0.115	▲ 0.155	0.015	21,534.35	▲ 212.03	108.48-49	108.34-35
T/N							-	▲ 0.113						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.025	▲ 0.059				-	▲ 0.112						
2W							-	▲ 0.113						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.137	▲ 0.130						
6M							▲ 0.155	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.215	▲ 0.159						
									日付	7/1	7/2	7/3	7/4	7/5
									日銀当預残	4,090,700	4,082,600	4,039,400	4,047,800	4,042,600
									準備預金残	3,584,200	3,568,000	3,544,300	3,542,000	3,537,200
									マネタリーベース	5,215,900	5,207,100	5,163,700	5,172,800	5,167,000
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.072%	▲0.074%
									コール市場残高	105,183	107,479	108,156	113,608	107,582
									うち無担	83,488	84,423	84,305	90,145	85,810
									うちO/N	56,133	52,223	51,320	54,070	50,270
									うち有担	21,695	23,056	23,851	23,463	21,772

●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)	177,145	2019/7/8	2019/7/9		80	80		▲0.350	▲0.350	

●2019年7月9日の予定

*5月の毎月動労統計調査速報	*国庫短期証券(843回)入札 (6ヶ月、23,000億円、7/10発行)
*6月のマネーストック	*5年利付国債入札 (19,000億円、7/10発行)
*5月の特定サービス産業動態統計速報	*交付税特別会計借入 (10,500億円、7/19借入)

◆本資料は信頼できるとさ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