

# Central Daily Market Report

2019年7月9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9日		2019年7月10日		2019年7月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		500			0
財政	▲ 500		▲ 28,400			2,000
資金過不足	▲ 100		▲ 27,900			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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
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						
E T F 買入						
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 100		▲ 28,100			2,000
当座預金残高	4,060,900		4,032,800			4,034,800
準備預金残高	3,541,300					
積み終了先	3,541,000					
超過準備	3,541,000				7月10日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	519,600				積数	800
					1日平均	100
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	80.00%		

## ●2019年7月9日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き各業態の資金調達需要が乏しく、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%のレンジで散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。調達サイドの参加者が限られていたことから一部出し残るオファーも見られた。ターム物は、閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/N(7/10-7/11)は、▲0.100~▲0.090%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10Y337~354、5Y136~139、30Y59~62、40Y9~11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、小幅上昇。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.185%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1961%、按分落札利回▲0.1902%と、年末越えの銘柄ということで海外勢の買いも入ったため強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.228~▲0.225%出合いと強含みで推移した。この他に、3M物が▲0.138%で、1Y物が▲0.210%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、石油、卸売、食料品業態で大型案件がみられ、償還総額400億円程度に対して、発行総額は2,300億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。本日はCP等買入オファーが、2,000億円オファーされた。平均落札レート▲0.002%、按分レート▲0.003%と、前回比(平均0.002%、按分▲0.003%)で平均は低下、按分は横ばいとなった。

## ●短期金融市場関連指標

2019/7/9	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.076				-	▲ 0.110	▲ 0.145	0.010	21,565.15	30.80	108.73-74	108.81-82
T/N			▲ 0.086				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.104						
2W							-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.109						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.137	▲ 0.127						
6M							▲ 0.227	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.210	▲ 0.159						
									日付	7/2	7/3	7/4	7/5	7/8
									日銀当預残	4,082,600	4,039,400	4,047,800	4,042,600	4,061,000
									準備預金残	3,568,000	3,544,300	3,542,000	3,537,200	3,549,200
									マネタリーベース	5,207,100	5,163,700	5,172,800	5,167,000	5,184,300
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.071%	▲0.072%	▲0.074%	▲0.075%
									コール市場残高	107,479	108,156	113,608	107,582	98,772
									うち無担	84,423	84,305	90,145	85,810	80,280
									うちO/N	52,223	51,320	54,070	50,270	45,165
									うち有担	23,056	23,851	23,463	21,772	18,492

## ●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	843	-	23,000	2019/7/10	2020/1/10	107,625.4	18,980.8	100.0960	▲0.1902%	61.1208%	100.0990	▲0.1961%	4,019.0
5年利付国債	140	0.10%	19,000	2019/7/10	2024/6/20	70,029.0	16,137.0	101.6600	▲0.2310%	89.1730%	101.6700	▲0.2330%	2,852.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/7/19	2020/1/17	281,175.0	10,500.09		0.0000%	3.7344%		0.0000%	

## ●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
CP等買入	2,000	2019/7/12			4,505	1,990	▲0.003		▲0.002	16.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	68,365	2019/7/9	2019/7/10		27	27		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/7/11	2019/7/18	2.88	1	1				

## ●2019年7月10日の予定

\*6月の企業物価指数

\*米国5月の卸売売上高

◆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