

# Central Daily Market Report

2019年7月12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12日		2019年7月16日		2019年7月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		800		1,000	
財政	▲ 28,300		5,200		2,000	
資金過不足	▲ 28,400		6,000		3,000	
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			700	▲ 700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入			10,300			
CP等買入	2,000	▲ 200		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入						
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 21,600		15,600		3,000	
当座預金残高	4,006,000		4,021,600		4,024,600	
準備預金残高	3,492,600					
積み終了先	3,492,600					
超過準備	3,492,500					
非準備預金先	513,400					
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,193,500	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2019年7月12日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、実質的な積み最終日となったが、引き続き調達ニーズは弱く、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~▲0.06%の出合いで始まった。一巡後は、最終調整のビッドが入る場面もあり、▲0.086~▲0.08%近辺で出合いが見られた。ターム物は、ショートタームの1~2W物で引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(7/16-7/17)は、▲0.100~▲0.075%程度の出合い。積み序盤であるが、投資家の資金調達意欲も見られていた。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、新積み期に入ったことや発行日要因から上昇した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.160~▲0.155%で出合う展開となったものの、応札額が9兆円台と少なく、平均落札利回▲0.1463%、按分落札利回▲0.1363%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~▲0.136%出合いと按分レート近辺で推移した。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は卸売業態で大型案件が観測されたものの、閑散としており、償還総額110億円程度に対して、発行総額は950億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

2019/7/12	無担(速報)			有担(速報)			短期	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				-	▲ 0.094	▲ 0.120	0.024	21,685.90	42.37	108.60-61	108.36-38
T/N							-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.055	▲ 0.058				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.062	0.000	▲ 0.048				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.106						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.139	▲ 0.124						
6M							▲ 0.245	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.210	▲ 0.160						
									日付	7/5	7/8	7/9	7/10	7/11
									日銀当預残	4,042,600	4,061,000	4,060,900	4,034,200	4,027,600
									準備預金残	3,537,200	3,549,200	3,541,300	3,518,600	3,513,100
									マネタリーベース	5,167,000	5,184,300	5,183,800	5,156,700	5,151,100
									無担O/N加重平均	▲0.074%	▲0.075%	▲0.076%	▲0.077%	▲0.076%
									コール市場残高	107,582	98,772	97,280	101,940	100,020
									うち無担	85,810	80,280	78,903	79,201	77,704
									うちO/N	50,270	45,165	41,513	40,701	41,574
									うち有担	21,772	18,492	18,377	22,739	22,316

## ●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	844	-	43,300	2019/7/16	2019/10/15	91,976.0	36,075.4	100.0340	▲0.1363%	58.5877%	100.0365	▲0.1463%	7,224.0

## ●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	2019/7/16	2019/7/29		655	655				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,800	2019/7/16			10,041	3,804	0.008		0.010	45.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,800	2019/7/16			10,231	3,813	0.010		0.011	61.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/7/16			3,325	1,810	0.016		0.020	64.3
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/7/16			1,021	401	0.026		0.030	32.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	78,124	2019/7/12	2019/7/16		1	1		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年7月16日の予定

*5月の石油等消費動態統計	*米国5月の企業在庫
	*米国6月の小売売上高
	*米国6月の鉱工業生産・設備稼働率

◆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