

Central Daily Market Report

2019年7月16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16日		2019年7月17日		2019年7月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		1,000		0	
財政	6,700		800		▲6,000	
資金過不足	7,500		1,800		▲6,000	
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						
国債買入	10,300		5,000			
CP等買入		▲700		▲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			700			
国債補完供給	▲400			400		
当預増減	16,700		7,700		▲6,000	
当座預金残高	4,022,700		4,030,400		4,024,400	
準備預金残高	3,500,700					
積み終了先	2,162,900					
超過準備	939,500					
非準備預金先	522,000					
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	80.20%	日数	3.23%		

●2019年7月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.08~▲0.065%の調達で始まった。新積み期に入った事で、一部では様子見姿勢が見られているものの、先週末対比ではレートは小幅上昇となった。一巡後は閑散で、▲0.08%近辺の出合いが散見された程度であった。ターム物は月内物を中心に出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/17-7/18)は、▲0.10~▲0.085%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。アウトライト市場は、店頭での買いが入ったこともあってか、3M物について▲0.145%でのまとまった出会いが見られた。この他に、引け際に3M物が▲0.150~▲0.148%、6M物が▲0.249~▲0.247%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。発行市場は、鉄鋼、小売業態でまとまった額の発行がみられたものの、発行総額は1,700億円程度と償還総額2,400億円程度を下回った。発行レートに変化は見られず、引続き低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/7/16	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				-	▲0.089	▲0.125	▲0.005	21,535.25	▲150.65	107.90-91	108.06-07
T/N							-	▲0.091						
S/N							-	-						
1W	▲0.060	0.000	▲0.055				-	▲0.094						
2W	▲0.060	▲0.015	▲0.039				-	▲0.097						
3W			▲0.050				-	▲0.103						
1M							-	▲0.108						
3M							▲0.148	▲0.123						
6M							▲0.249	▲0.149						
1Y							▲0.210	▲0.160						
									日付	7/8	7/9	7/10	7/11	7/12
									日銀当預残	4,061,000	4,060,900	4,034,200	4,027,600	4,006,000
									準備預金残	3,549,200	3,541,300	3,518,600	3,513,100	3,492,600
									マネタリーベース	5,184,300	5,183,800	5,156,700	5,151,100	5,129,500
									無担O/N加重平均	▲0.075%	▲0.076%	▲0.077%	▲0.076%	▲0.076%
									コール市場残高	98,772	97,280	101,940	100,020	102,085
									うち無担	80,280	78,903	79,201	77,704	80,108
									うちO/N	45,165	41,513	40,701	41,574	44,193
									うち有担	18,492	18,377	22,739	22,316	21,977

●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	応募総額(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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/7/17			16,482	4,812	▲0.012		▲0.012	96.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	168,511	2019/7/16	2019/7/17		366	366		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/7/18	2019/7/25	2.88	0	0				

●2019年7月17日の予定

*米国ページブック	*20年利付国債入札(9,000億円、7/18発行)
*米国6月の住宅着工件数	*交付税特別会計借入(10,500億円、7/25借入)
*ユーロ圏6月の消費者物価指数改定値	
*英国6月の消費者物価指数	

◆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。

◆本資料は何ら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お客様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