

●資金需給

単位：億円	2019年7月17日	2019年7月18日	2019年7月19日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	1,100	▲ 400	▲ 1,000
財政	▲ 1,300	▲ 8,900	1,000
資金過不足	▲ 200	▲ 9,300	0
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		2,500	
国債買入	5,000		
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			1,100
社債等買入		▲ 100	▲ 1,100
E T F 買入	700		
国債補完供給	▲ 200	400	200
当預増減	5,500	▲ 6,800	0
当座預金残高	4,028,200	4,021,400	4,021,400
準備預金残高	3,493,600		
積み終了先	3,415,600		7月18日以降の残り所要積立額
超過準備	2,981,300		積数 120,000
非準備預金先	534,600		1日平均 4,100
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	96.24%	日数 6.45%

●2019年7月17日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀・証券業態を中心に▲0.07～▲0.06%の調達で始まった。新積み期に入り、調達意欲は旺盛で、全般的に取り上げりの展開となった。一巡後も同水準の出会いが見られた。ターム物もレートは上昇基調で、月内物を中心に引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/N(7/18-7/19)は、▲0.10～▲0.09%程度 of 出会い。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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.009%、按分落札利回較差+0.008%と、在庫調整の売りから弱めの結果となった。マーケットでは、6M物が▲0.248～▲0.235%、1Y物が▲0.210%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、輸送用機器等の複数業態で大口での調達が見られ、発行総額は2,100億円程度まで膨らんだが、1,000億円弱の大型発行の落ちがあったこともあり、償還総額2,400億円程度と償還超のマーケットとなった。発行レートは概ね横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/7/17	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.098	▲ 0.130	▲ 0.005	21,469.18	▲ 66.07	108.19-21	108.26-27
T/N							-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.048				-	▲ 0.100						
2W	▲ 0.050	▲ 0.010	▲ 0.030				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.104						
1M	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.109						
3M			▲ 0.040				▲ 0.145	▲ 0.125						
6M							▲ 0.250	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.209	▲ 0.160						
									日付	7/9	7/10	7/11	7/12	7/16
									日銀当預残	4,060,900	4,034,200	4,027,600	4,006,000	4,022,700
									準備預金残	3,541,300	3,518,600	3,513,100	3,492,600	3,500,700
									マネタリーベース	5,183,800	5,156,700	5,151,100	5,129,500	5,145,500
									無担O/N加重平均	▲0.076%	▲0.077%	▲0.076%	▲0.076%	▲0.072%
									コール市場残高	97,280	101,940	100,020	102,085	107,112
									うち無担	78,903	79,201	77,704	80,108	85,712
									うちO/N	41,513	40,701	41,574	44,193	55,102
									うち有担	18,377	22,739	22,316	21,977	21,400

●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)
20年利付国債	169	0.30%	9,000	2019/7/18	2039/6/20	35,638.0	7,282.00	100.9500	0.2490%	84.8219%	100.9600	0.2490%	1,708.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/7/25	2020/1/24	293,232.0	10,500.16		0.0000%	3.5809%		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
国庫短期証券買入	2,500	2019/7/18			11,310	2,503	0.008		0.009	82.3
社債等買入	1,250	2019/7/23			2,287	1,250	▲0.084		▲0.063	64.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	91,799	2019/7/17	2019/7/18		169	169		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,385	2019/7/17	2019/7/18		9	9		▲0.350	▲0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第99回 2019/7/19	2020/7/17	0	1,116
被災地金融支援オペ(熊本)	第38回 2019/7/19	2020/7/17	0	0

●2019年7月18日の予定

*6月の貿易統計	*国庫短期証券(845回)入札 (1年物、19,000億円、7/22発行)
----------	--

◆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