

Central Daily Market Report

2019年7月18日(木)
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18日		2019年7月19日		2019年7月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		200		1,000	
財政	▲ 13,200		7,700		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 13,500		7,900		▲ 1,000	
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	2,500					
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			1,100	▲ 1,100		
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F 買入						
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 11,000		7,500		▲ 3,600	
当座預金残高	4,017,200		4,024,700		4,021,100	
準備預金残高	3,491,900					
積み終了先	3,447,600					
超過準備	3,433,300					
非準備預金先	525,300					
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	98.07%	日数	9.68%		

●2019年7月18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・証券業態を中心に調達が見られた。朝方は前日比横ばいの▲0.07~▲0.06%の出会い。一巡後も同水準の取引が見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/19-7/22)は、▲0.10~▲0.085%程度のお合い。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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.190%から▲0.210%まで買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1971%、按分落札利回▲0.1931%と、WI取引を反映して落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.205~▲0.198%お合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、ノンバンクや石油・石炭業態で比較的まとまった額の調達を実施され、発行総額は1,800億円程度と償還総額の1,400億円程度を上回った。発行レートは0%近辺の狭いレンジで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/7/18	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.065				-	▲ 0.093	▲ 0.140	▲ 0.010	21,046.24	▲ 422.94	107.93-95	107.76-77
T/N			▲ 0.070				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.039				-	▲ 0.100						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.032				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.145	▲ 0.122						
6M							▲ 0.250	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.204	▲ 0.160						
									日付	7/10	7/11	7/12	7/16	7/17
									日銀当預残	4,034,200	4,027,600	4,006,000	4,022,700	4,028,200
									準備預金残	3,518,600	3,513,100	3,492,600	3,500,700	3,493,600
									マネタリーベース	5,156,700	5,151,100	5,129,500	5,145,500	5,149,900
									無担O/N加重平均	▲0.077%	▲0.076%	▲0.076%	▲0.072%	▲0.066%
									コール市場残高	101,940	100,020	102,085	107,112	116,836
									うち無担	79,201	77,704	80,108	85,712	96,303
									うちO/N	40,701	41,574	44,193	55,102	63,433
									うち有担	22,739	22,316	21,977	21,400	20,533

●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	845	-	19,000	2019/7/22	2020/7/20	71,080.0	15,557.4	100.1930	▲0.1931%	70.6581%	100.1970	▲0.1971%	3,442.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	88,022	2019/7/18	2019/7/19		33	33		▲0.350	▲0.350	

●2019年7月19日の予定

*6月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.6%	*米国7月のミシガン大学、 消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(846回)入札 (3ヶ月、42,700億円、7/22発行) *流動性供給入札 (4,000億円、7/22発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、7/30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