

Central Daily Market Report

2019年7月19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19日		2019年7月22日		2019年7月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		600		▲ 1,000	
財政	7,600		▲ 100		2,000	
資金過不足	7,900		500		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			2,400	▲ 2,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 600		
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			1,300	
E T F 買入			100			
国債補完供給						
当預増減	7,500		▲ 200		2,300	
当座預金残高	4,024,700		4,024,500		4,026,800	
準備預金残高	3,488,700					
積み終了先	3,486,800					
超過準備	3,473,500				7月22日以降の残り所要積立額 積数 16,000	
非準備預金先	536,000				1日平均 600	
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	99.50%	日数	19.35%		

●2019年7月19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・証券業態の調達を中心となった。週末ながら取り上がる動きは見られず、出合いのレンジは▲0.07～▲0.06%で前日比横ばい。一巡後も同水準の出合いが見られた。ターム物は月内物の出合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/N(7/22-7/23)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、発行日要因からか小幅上昇。アウトライ市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.148～▲0.145%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.1407%、按分落札利回▲0.1303%とテールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.135～▲0.130%出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、1Y物が▲0.204～▲0.203%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。発行市場は案件膨らまず、発行総額800億円程度、償還総額600億円程度にとどまった。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

2019/7/19	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	▲ 0.064				-	▲ 0.088	▲ 0.140	0.000	21,466.99	420.75	107.40-42	107.64-65
T/N			▲ 0.070				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.042				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.041				-	▲ 0.097						
3W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.020				-	▲ 0.099						
1M			▲ 0.017				-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.135	▲ 0.122						
6M							▲ 0.260	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.204	▲ 0.160						
									日付	7/11	7/12	7/16	7/17	7/18
									日銀当預残	4,027,600	4,006,000	4,022,700	4,028,200	4,017,200
									準備預金残	3,513,100	3,492,600	3,500,700	3,493,600	3,491,900
									マネタリーベース	5,151,100	5,129,500	5,145,500	5,149,900	5,139,200
									無担O/N加重平均	▲0.076%	▲0.076%	▲0.072%	▲0.066%	▲0.065%
									コール市場残高	100,020	102,085	107,112	116,836	114,846
									うち無担	77,704	80,108	85,712	96,303	91,332
									うちO/N	41,574	44,193	55,102	63,433	59,087
									うち有担	22,316	21,977	21,400	20,533	23,514

●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	846	-	42,700	2019/7/22	2019/10/21	102,592.0	35,019.7	100.0325	▲0.1303%	60.6545%	100.0351	▲0.1407%	7,680.0
流動性供給	290	-	4,000	2019/7/22		19,150.0	3,986.0		▲0.0090%	96.5997%		▲0.0090%	
交付税特会	-	-	10,500	2019/7/30	2020/1/28	255,701.0	10,500.24		0.0000%	4.1065%		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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	15,000	2019/7/22	2019/8/5		2,406	2,406				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	12,484	2019/7/19	2019/7/22		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,645	2019/7/19	2019/7/22		13	13		▲0.350	▲0.350	

●2019年7月22日の予定

特にありません。

◆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