

# Central Daily Market Report

2019年7月22日(月)  
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22日 需給速報	2019年7月23日 需給予想	2019年7月24日 当社予想			
銀行券	400	▲ 300	0			
財政	400	1,700	▲ 3,000			
資金過不足	800	1,400	▲ 3,000			
<b>金融調節</b>	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			12,900			
CP等買入		▲ 600	▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入			1,300			
E T F 買入	100		600			
国債補完供給	▲ 400		400			
当預増減	▲ 300		16,500			▲ 3,000
当座預金残高	4,024,400		4,040,900			4,037,900
準備預金残高	3,512,300					
積み終了先	3,511,300					
超過準備	3,510,700				7月23日以降の残り所要積立額 積数	14,400
非準備預金先	512,100				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	99.55%	日数	22.58%		

## ●2019年7月22日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、先週に引き続き、邦銀・証券業態から▲0.07~▲0.06%の調達で始まった。一巡後も同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はロール案件が散見された程度であった。

### <レポ市場>

GC T/N(7/23-7/24)は、▲0.095~▲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10Y337~355、5Y136~139、30Y59~63、40Y9~12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。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、3M物が▲0.135~▲0.134%で出合った。また、引け際に6M物が▲0.260%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額100億円程度に対して、発行総額は650億円程度と発行超であった。一部の医薬品業態から大型の発行が見られたものの、案件数が少なく閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/7/22	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	▲ 0.063				-	▲ 0.092	▲ 0.140	0.000	21,416.79	▲ 50.20	107.82-83	107.86-87
T/N			▲ 0.070				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.045				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.033				-	▲ 0.095						
3W			0.001				-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.135	▲ 0.121						
6M							▲ 0.260	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.203	▲ 0.160						
									日付	7/12	7/16	7/17	7/18	7/19
									日銀当預残	4,006,000	4,022,700	4,028,200	4,017,200	4,024,700
									準備預金残	3,492,600	3,500,700	3,493,600	3,491,900	3,488,700
									マネタリーベース	5,129,500	5,145,500	5,149,900	5,139,200	5,146,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.076%	▲ 0.072%	▲ 0.066%	▲ 0.065%	▲ 0.064%
									コール市場残高	102,085	107,112	116,836	114,846	117,748
									うち無担	80,108	85,712	96,303	91,332	93,898
									うちO/N	44,193	55,102	63,433	59,087	62,613
									うち有担	21,977	21,400	20,533	23,514	23,850

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,800	2019/7/23			14,242	3,809	0.000		0.001	18.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,800	2019/7/23			11,346	3,802	0.000		0.001	68.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/7/23			10,730	4,802	▲ 0.001		0.000	68.2
国債買入(物価連動債)	250	2019/7/23			1,089	250	▲ 0.010		▲ 0.054	53.3
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	312,862	2019/7/22	2019/7/23		358	358		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年7月23日の予定

*月例経済報告	*米国6月の中古住宅販売	*40年利付国債入札(4,000億円、7/24発行)
---------	--------------	----------------------------

◆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