

Central Daily Market Report

2019年7月23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23日 需給速報	2019年7月24日 需給予想	2019年7月25日 当社予想			
銀行券	▲ 300	0	▲ 1,000			
財政	0	▲ 5,700	10,000			
資金過不足	▲ 300	▲ 5,700	9,000			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	12,900					
CP等買入		▲ 100	▲ 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	600		300			
国債補完供給	▲ 100	400	100			
当預増減	14,700	▲ 400	9,000			
当座預金残高	4,039,100	4,038,700	4,047,700			
準備預金残高	3,514,900					
積み終了先	3,513,900			7月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,513,900			積数	13,300	
非準備預金先	524,200			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	99.58%	日数	25.81%		

●2019年7月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き邦銀・証券業態の調達为中心となった。朝方は前日比横ばいの▲0.07~▲0.06%の出会い。一巡後は▲0.07%台の散発的な出会いが見られた。ターム物は案件少なく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(7/24-7/25)は、▲0.095~▲0.085%程度の出会い。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10Y337~355、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、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5,000億円(前回比+2,500億円)でオファーされた。オペ通告後に3M物で▲0.132%での出会いが見られる中、平均落札利回較差+0.009%、按分落札利回較差+0.007%と、在庫調整の売りから弱めの結果となった。その後のマーケットでは、特段の出会いは見られなかった。

<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700億円程度に対して、発行総額は2,300億円程度と大きく発行超となった。5・10日発行となり複数業態から大型の発行が見られ、活況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

2019/7/23	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				-	▲ 0.088	▲ 0.150	▲ 0.010	21,620.88	204.09	107.89-90	108.10-11
T/N			▲ 0.070				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.092						
3W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.100						
3M	▲ 0.040	0.060	0.010				▲ 0.132	▲ 0.119						
6M							▲ 0.258	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.201	▲ 0.160						
									日付	7/16	7/17	7/18	7/19	7/22
									日銀当預残	4,022,700	4,028,200	4,017,200	4,024,700	4,024,400
									準備預金残	3,500,700	3,493,600	3,491,900	3,488,700	3,512,400
									マネタリーベース	5,145,500	5,149,900	5,139,200	5,146,400	5,145,700
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.066%	▲0.065%	▲0.064%	▲0.063%
									コール市場残高	107,112	116,836	114,846	117,748	112,857
									うち無担	85,712	96,303	91,332	93,898	92,505
									うちO/N	55,102	63,433	59,087	62,613	53,800
									うち有担	21,400	20,533	23,514	23,850	20,352

●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)
40年利付国債	12	0.50%	4,000	2019/7/24	2059/3/20	12,077.0	3,996.00		0.4250%	25.1445%			

●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	5,000	2019/7/24			17,686	5,002	0.007		0.009	28.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	125,789	2019/7/23	2019/7/24		38	38		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,559	2019/7/23	2019/7/24		49	49		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2019/7/25	2019/8/1	2.88	0	0				

●2019年7月24日の予定

*5月の景気動向指数改訂状況	*米国6月の新築一戸建て販売件数	*交付税特別会計借入(10,500億円、8/1借入)
----------------	------------------	----------------------------

◆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