

# Central Daily Market Report

2019年7月25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25日		2019年7月26日		2019年7月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 800		0	
財政	11,200		700		▲ 1,000	
資金過不足	10,100		▲ 100		▲ 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						▲ 700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 300		▲ 100		
ETF買入	300					
国債補完供給						
当預増減	9,800		▲ 300		▲ 1,700	
当座預金残高	4,046,900		4,046,600		4,044,900	
準備預金残高	3,520,500					
積み終了先	3,519,400				7月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,519,400				積数 11,000	
非準備預金先	526,400				1日平均 500	
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	99.66%	日数	32.26%		

## ●2019年7月25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▲0.075~▲0.06%の出会い。一巡後は、▲0.08%台の出会いが散見された程度で、調達意欲は限定的であった。ターム物はロール案件が中心であった。

### <レポ市場>

GC T/N(7/26-7/29)は、▲0.09~▲0.08%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10Y337~355、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。アウトライイト市場は、3M物の入札を控え動きなく閑散な中、1Y物が▲0.197%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750億円程度に対して、発行総額は1,400億円程度と発行超であった。一部の鉄鉱業態から大型の発行が見られたものの、案件数は膨らまず落ち着いた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

2019/7/25	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.082	▲ 0.155	▲ 0.005	21,756.55	46.98	108.19-20	108.05-06
T/N			▲ 0.070				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.085						
2W							-	▲ 0.088						
3W			0.001				-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.040	▲ 0.017	▲ 0.033				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.132	▲ 0.114						
6M							▲ 0.260	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.160						
									日付	7/18	7/19	7/22	7/23	7/24
									日銀当預残	4,017,200	4,024,700	4,024,400	4,039,100	4,037,100
									準備預金残	3,491,900	3,488,700	3,512,400	3,514,900	3,518,200
									マネタリーベース	5,139,200	5,146,400	5,145,700	5,160,600	5,158,700
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.065%	▲0.067%
									コール市場残高	114,846	117,748	112,857	124,840	123,160
									うち無担	91,332	93,898	92,505	101,703	101,113
									うちO/N	59,087	62,613	53,800	62,728	61,488
									うち有担	23,514	23,850	20,352	23,137	22,047

## ●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)
2年利付国債	403	0.10%	20,000	2019/8/1	2021/8/1	77,084.0	16,378.00	100.6200	▲0.2080%	64.5900%	100.6250	▲0.2110%	3,614.0

## ●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)	252,495	2019/7/25	2019/7/26		0	0				

## ●2019年7月26日の予定

*7月の都区部消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.6%	*米国4-6月期のGDP速報値	*国庫短期証券(847回)入札 (3ヶ月、43,200億円、7/29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