

# Central Daily Market Report

2019年7月26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26日 需給速報	2019年7月29日 需給予想	2019年7月30日 当社予想			
銀行券	▲ 800	100	0			
財政	400	3,300	2,000			
資金過不足	▲ 400	3,400	2,000			
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	▲ 700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			3,200			
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F 買入			800			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 700		7,000			2,000
当座預金残高	4,046,200		4,053,200			4,055,200
準備預金残高	3,534,900					
積み終了先	3,533,600				7月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,533,600				積数	7,000
非準備預金先	511,300				1日平均	400
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	99.78%	日数	41.94%		

## ●2019年7月26日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因により、様子見姿勢から小幅低下となった。朝方は国内勢を中心に▲0.08~▲0.06%の出会い。一巡後も調達意欲は限定的で、▲0.08~▲0.07%の出会いが見られた。ターム物はショートターム物の出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(7/29-7/30)は、▲0.085~▲0.075%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、小幅上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.130%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1271%、按分落札利回▲0.1202%と前回債からレートが上昇する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.125~▲0.122%の出会いと按分レート近辺で推移した。

### <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1,500億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と発行超であった。複数業態から発行が見られ案件数は膨らんだものの、小型案件を中心とするやや落ち着いたマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。CP等買入オベが2,500億円オファーされた。入札結果は平均落札レート0.003%・按分レート▲0.001%と、前回(平均▲0.002%・按分▲0.003%)比で平均・按分レート共に上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/7/26	無担(速報)			有担(速報)			短期 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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.073				-	▲ 0.080	▲ 0.155	0.000	21,658.15	▲ 98.40	108.67-68	108.62-63
T/N	▲ 0.080	▲ 0.075	▲ 0.079				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.000	▲ 0.048				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.045	▲ 0.005	▲ 0.035				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.097						
3M			▲ 0.035				▲ 0.124	▲ 0.114						
6M							▲ 0.260	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.160						
									日付	7/19	7/22	7/23	7/24	7/25
									日銀当預残	4,024,700	4,024,400	4,039,100	4,037,100	4,046,900
									準備預金残	3,488,700	3,512,400	3,514,900	3,518,200	3,520,500
									マネタリーベース	5,146,400	5,145,700	5,160,600	5,158,700	5,169,600
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.063%	▲0.065%	▲0.067%	▲0.071%
									コール市場残高	117,748	112,857	124,840	123,160	111,818
									うち無担	93,898	92,505	101,703	101,113	89,602
									うちO/N	62,613	53,800	62,728	61,488	56,737
									うち有担	23,850	20,352	23,137	22,047	22,216

## ●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	847	-	43,200	2019/7/29	2019/10/28	115,261.0	35,346.7	100.0300	▲0.1202%	21.4670%	100.0317	▲0.1271%	7,853.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/7/29	2019/8/13		655	655				
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/7/29			1,734	501	0.006		0.010	42.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/7/29			4,410	1,810	0.002		0.003	46.0
国債買入(残存期間25年超)	400	2019/7/29			1,776	406	0.004		0.005	25.6
CP等買入	2500	2019/7/31			6,060	2,450	▲0.001		0.003	88.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	61,238	2019/7/26	2019/7/29		100	100		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年7月29日の予定

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、30日まで)  
\*6月の商業動態統計速報

◆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