

Central Daily Market Report

2019年7月29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29日 需給速報	2019年7月30日 需給予想	2019年7月31日 当社予想			
銀行券	100	100	▲ 400			
財政	5,900	100	2,300			
資金過不足	6,000	200	1,900			
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		▲ 400			2,500	
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		400			
国債補完供給		100				
当預増減	9,600	500	4,400			
当座預金残高	4,055,800	4,056,300	4,060,700			
準備預金残高	3,559,400					
積み終了先	3,557,700					
超過準備	3,557,700			7月30日以降の残り所要積立額 積数	5.400	
非準備預金先	496,400			1日平均	300	
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	99.83%	日数	45.16%		

●2019年7月29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▲0.08~▲0.06%の調達で始まった。一巡後は様子見姿勢が強く、▲0.08%近辺の出合いが見られた程度であった。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(7/30-7/31)は、▲0.080~▲0.070%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10Y336~355、5Y136~140、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。アウトライト市場では、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は、2営業日後が月末発行にあたり、機械・不動産・鉄鋼等幅広い業態から大型発行が実施されたが、1兆3,000億円程度の償還に対して、9,300億円程度の発行にとどまるなど、償還超のマーケットとなった。発行レートは、一部期越え銘柄では低水準での決着も見られたが、概ね横ばい圏の決着となった。

●短期金融市場関連指標

2019/7/29	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.079	▲ 0.150	0.005	21,616.80	▲ 41.35	108.63-65	108.64-65
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.050				-	▲ 0.084						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.124	▲ 0.114						
6M							▲ 0.260	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.160						
									日付	7/22	7/23	7/24	7/25	7/26
									日銀当預残	4,024,400	4,039,100	4,037,100	4,046,900	4,046,200
									準備預金残	3,512,400	3,514,900	3,518,200	3,520,500	3,534,900
									マネタリーベース	5,145,700	5,160,600	5,158,700	5,169,600	5,169,800
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.065%	▲0.067%	▲0.071%	▲0.073%
									コール市場残高	112,857	124,840	123,160	111,818	111,901
									うち無担	92,505	101,703	101,113	89,602	90,685
									うちO/N	53,800	62,728	61,488	56,737	57,120
									うち有担	20,352	23,137	22,047	22,216	21,216

●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	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	15,996	2019/7/29	2019/7/30		48	48		▲0.350	▲0.350	

●2019年7月30日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*米国FOMC(1日目)
*黒田日銀総裁定例会見 *経済・物価情勢の展望	*米国5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*6月の完全失業率(市場予想：2.4%)	*米国6月の個人所得・消費支出
*6月の有効求人倍率(市場予想：1.62倍)	*米国7月のCB消費者信頼感指数
*6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲2.0%)	

◆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論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