

Central Daily Market Report

2019年7月11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11日		2019年7月12日		2019年7月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 200			1,000
財政	▲ 5,600		▲ 27,000			5,000
資金過不足	▲ 6,500		▲ 27,200			6,000
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			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100	2,000	▲ 200		
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		
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 6,600		▲ 20,400			5,300
当座預金残高	4,027,600		4,007,200			4,012,500
準備預金残高	3,513,100					
積み終了先	3,513,000					
超過準備	3,513,000				7月12日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	514,500				積数	400
					1日平均	100
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,088,800
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	86.67%		

●2019年7月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、実質的な積み最終日の前日となったが、引き続き調達ニーズは弱く、低いレートでの取引が中心となった。立ち上がりは邦銀、証券業態の調達を中心に▲0.086~▲0.05%の出合いで始まった。本日も調達サイドの参加者が限られていた事で、出し残るオファーが多数見られる中、一巡後は、▲0.086~▲0.07%で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームの1W~2W物で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(7/12-7/16)は、▲0.110~▲0.090%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10Y337~354、5Y136~139、30Y59~62、40Y9~11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、低水準で推移した。アウトライト市場では、短国買入オベが5,000億円(前日比+2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.009%、按分落札利回較差+0.005%と、需給環境に改善が見られる落ち着いた結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.145~▲0.140%、6M物が▲0.229~▲0.220%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、ゴム、卸売業態で大型案件がみられたが、全体的に発行額はやや控え目で、償還総額3,100億円程度に対して、発行総額は2,200億円程度と償還超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/7/11	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.076				-	▲ 0.103	▲ 0.144	▲ 0.014	21,643.53	110.05	108.33-34	108.05-06
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.110						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.230	▲ 0.025				-	▲ 0.106						
2W	▲ 0.065	▲ 0.060	▲ 0.064				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.109						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.145	▲ 0.126						
6M							▲ 0.228	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.210	▲ 0.160						
									日付	7/4	7/5	7/8	7/9	7/10
									日銀当預残	4,047,800	4,042,600	4,061,000	4,060,900	4,034,200
									準備預金残	3,542,000	3,537,200	3,549,200	3,541,300	3,518,600
									マネタリーベース	5,172,800	5,167,000	5,184,300	5,183,800	5,156,700
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.074%	▲0.075%	▲0.076%	▲0.077%
									コール市場残高	113,608	107,582	98,772	97,280	101,940
									うち無担	90,145	85,810	80,280	78,903	79,201
									うちO/N	54,070	50,270	45,165	41,513	40,701
									うち有担	23,463	21,772	18,492	18,377	22,739

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
流動性供給	289	-	6,000	2019/7/12		16,526.0	5,969.0		▲0.0130%	42.7234%		▲0.0150%	
エネルギー対策	-	-	7,000	2019/7/22	2020/7/20	139,768.0	6,999.98		0.0000%	5.0084%		0.0000%	

●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	2019/7/12			18,064	5,003	0.005		0.009	45.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	22,473	2019/7/11	2019/7/12		85	85		▲0.350	▲0.350	

●2019年7月12日の予定

*米6月の生産者物価指数

*国庫短期証券(844回)入札
(3ヶ月、43,300億円、7/16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