

Central Daily Market Report

2019年7月24日(水)
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24日		2019年7月25日		2019年7月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 7,200		11,400		2,000	
資金過不足	▲ 7,300		10,500		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						
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		▲ 300		
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		
E T F 買入	300		300			
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 2,000		10,200		1,000	
当座預金残高	4,037,100		4,047,300		4,048,300	
準備預金残高	3,518,200					
積み終了先	3,517,100					
超過準備	3,517,100					
非準備預金先	518,900					
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	99.62%	日数	29.03%		

●2019年7月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態ともに調達レートの目線を切り下げる展開となった。立ち上がりは邦銀・証券業態を中心に前日対比小幅低下で▲0.075~▲0.06%の出合い。一巡後も同水準での出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(7/25-7/26)は、▲0.09~▲0.075%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10Y337~355、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。アウトライト市場は、動意なく閑散で、3M物が▲0.132%、6Mが▲0.260%で少額出合った程度だった。

<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100億円程度に対して、発行総額は900億円程度と発行超であった。一部の卸売業態から大型の発行が見られたものの、案件数が少なく閑散とし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

2019/7/24	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.067				-	▲ 0.085	▲ 0.150	0.000	21,709.57	88.69	108.23-24	108.03-05
T/N			▲ 0.070				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.088						
3W			0.001				-	▲ 0.090						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.132	▲ 0.116						
6M							▲ 0.260	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.160						
									日付	7/17	7/18	7/19	7/22	7/23
									日銀当預残	4,028,200	4,017,200	4,024,700	4,024,400	4,039,100
									準備預金残	3,493,600	3,491,900	3,488,700	3,512,400	3,514,900
									マネタリーベース	5,149,900	5,139,200	5,146,400	5,145,700	5,160,600
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.065%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.065%
									コール市場残高	116,836	114,846	117,748	112,857	124,840
									うち無担	96,303	91,332	93,898	92,505	101,703
									うちO/N	63,433	59,087	62,613	53,800	62,728
									うち有担	20,533	23,514	23,850	20,352	23,137

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/8/1	2020/1/30	265,410.0	10,500.04		0.0000%	3.9562%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	61,851	2019/7/24	2019/7/25		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	12,766	2019/7/24	2019/7/25		0	0				

●2019年7月25日の予定

*6月の企業向けサービス価格指数	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*2年利付国債入札(20,000億円、8/1発行)
	*米国6月の耐久財新規受注	

◆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