

Central Daily Market Report

2019年7月31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31日		2019年8月1日		2019年8月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 400		0	
財政	3,700		▲ 27,000		▲ 78,000	
資金過不足	4,000		▲ 27,400		▲ 78,000	
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			2,500			
国債買入			12,700			
CP等買入	2,500	▲ 1,000				
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				
E T F 買入	300					
国債補完供給	▲ 300		300			
当預増減	5,400		▲ 11,900		▲ 78,000	
当座預金残高	4,059,500		4,047,600		3,969,600	
準備預金残高	3,546,700					
積み終了先	3,546,000					
超過準備	3,546,000					
非準備預金先	512,800					
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,186,400	
準備預金進捗率	実績	99.88%	日数	51.61%		

●2019年7月31日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀・証券業態の調達を中心となった。月末要因から調達を控える先が見られたものの、一部では取り上がる動きも見られ、朝方は▲0.075~▲0.055%の出会い。一巡後は様子見姿勢が強く、閑散であった。ターム物はロール案件が中心であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/1-8/2)は、▲0.080~▲0.055%程度 of 出会い。後場から引けにかけて、レートを切り上げた。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、レート上昇となった。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回比▲2,500億円)でオフアされた。オペ通告後に3M物が▲0.115%で出合う展開となる中、平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差+0.005%と、在庫調整の売りから小甘い結果となった。

<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、償還は800億円弱であったが、発行は700億円弱の水準にとどまり、大型発行は鉄鋼業態から見られた程度であった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2019/7/31	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	▲ 0.071				-	▲ 0.074	▲ 0.160	▲ 0.005	21,521.53	▲ 187.78	108.55-56	108.55-56
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.050	▲ 0.054				-	▲ 0.079						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.088						
1M	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.026				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.123	▲ 0.114						
6M							▲ 0.260	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.160						
									日付	7/24	7/25	7/26	7/29	7/30
									日銀当預残	4,037,100	4,046,900	4,046,200	4,055,800	4,054,100
									準備預金残	3,518,200	3,520,500	3,534,900	3,559,400	3,556,500
									マネタリーベース	5,158,700	5,169,600	5,169,800	5,179,200	5,177,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.067%	▲ 0.071%	▲ 0.073%	▲ 0.072%	▲ 0.071%
									コール市場残高	123,160	111,818	111,901	110,345	102,309
									うち無担	101,113	89,602	90,685	87,534	81,160
									うちO/N	61,488	56,737	57,120	51,629	47,705
									うち有担	22,047	22,216	21,216	22,811	21,149

●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	2019/8/8	2020/2/7	250,257.0	10,500.02		0.0000%	4.1958%		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	2,500	2019/8/1			10,316	2,504	0.005		0.007	40.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,800	2019/8/1			13,719	3,808	0.005		0.006	41.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,800	2019/8/1			10,023	3,807	▲ 0.004		▲ 0.003	32.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/8/1			15,838	4,819	▲ 0.007		▲ 0.006	56.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	32,996	2019/7/31	2019/8/1		315	315		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年8月1日の予定

*両宮日銀副総裁、鹿児島県金融経済懇談会において講演	*英中銀MPC結果発表 *米国6月の建設支出 *米国7月のISM製造業景況指数	*10年利付国債入札 (21,000億円、8/2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