

Central Daily Market Report

2017年7月3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	2017年7月3日		2017年7月4日		2017年7月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		0		1,000	
財政	▲ 3,800		▲ 26,200		3,000	
資金過不足	▲ 3,300		▲ 26,200		4,000	
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	1,600	▲ 1,800				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入			5,100		8,800	
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						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 200	2,800		200		
当預増減	▲ 1,000		▲ 13,800		12,800	
当座預金残高	3,628,500		3,614,700		3,627,500	
準備預金残高	3,230,600					
積み終了先	3,230,500		7月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,230,500		積数		2,000	
非準備預金先	397,900		1日平均		200	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					2,893,900	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	60.00%		

●2017年7月3日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比横ばいの322兆円(当座預金残高見込みは362兆8,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態の調達で▲0.070~▲0.045%の出合い。四半期末要因の剥落から複数の資金調達サイドからビッドが散見された。一巡後は▲0.075%で調整の出合いが見られた程度であった。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.04%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/4-7/5)は▲0.055~▲0.050%程度、S/N(7/5-7/6)は▲0.050%程度での出合い。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5Y130~132、10Y334~347、20Y155~161などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先T/Nは低水準で推移。アウトライト市場は様子見閑散。特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先S/Nは低位横ばいで推移。5・10日に係る発行となり、幅広い業態から大型発行案件が見られ、償還総額1,900億円程度に対し、発行総額は2,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは低位横ばい圏で落ち着いていた。

●短期金融市場関連指標

2017/7/3	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.062	0.080	▲ 0.004	20,055.80	22.37	112.23-25	112.79-80
T/N			0.001				-	▲ 0.052						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.047	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.063						
2W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.040				-	▲ 0.067						
3W			▲ 0.055				-	▲ 0.069						
1M	▲ 0.030	▲ 0.013	▲ 0.022				-	▲ 0.075						
3M							▲ 0.094	▲ 0.093						
6M							▲ 0.092	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.091	▲ 0.150						
									日付	6/26	6/27	6/28	6/29	6/30
									日銀当預残	3,604,800	3,622,400	3,624,900	3,625,100	3,629,500
									準備預金残	3,223,500	3,242,300	3,232,500	3,236,900	3,196,000
									マネタリーベース	4,652,400	4,670,800	4,673,800	4,675,300	4,680,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.053%	▲ 0.050%	▲ 0.051%	▲ 0.053%	▲ 0.069%
									コール市場残高	91,925	95,429	91,188	91,744	78,649
									うち無担	72,184	75,798	71,153	72,130	60,244
									うちO/N	40,674	44,838	40,703	43,390	45,204
									うち有担	19,741	19,631	20,035	19,614	18,405

●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)	応募額(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	応募総額(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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/7/5			7,652	2,801	▲ 0.014		▲ 0.011	84.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/7/5			9,535	3,005	▲ 0.002		▲ 0.001	90.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/7/5			5,356	2,011	0.001		0.002	33.4
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/7/5			2,573	1,001	0.001		0.002	80.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	29,479	2017/7/3	2017/7/4		180	180		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,250	2017/7/3	2017/7/4		1	1		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年7月4日の予定

*6月のマネタリーベース	*米国祝日(Independence Day)	*10年利付国債入札(23,000億円、7/6発行)
*6月実績/7月見込み財政資金対民間収支		

◆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