

Central Daily Market Report

2017年7月4日(火)

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4日		2017年7月5日		2017年7月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		100		▲ 1,000	
財政	▲ 27,000		3,500		▲ 22,000	
資金過不足	▲ 27,000		3,600		▲ 23,000	
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	7,500					
国債買入	5,100		8,900			
CP等買入		▲ 400		▲ 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			200			
国債補完供給	▲ 600	200		600		
当預増減	▲ 15,200		12,900		▲ 23,000	
当座預金残高	3,613,300		3,626,200		3,603,200	
準備預金残高	3,226,300					
積み終了先	3,226,100				7月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,226,100				積数 1,700	
非準備預金先	387,000				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	99.94%	日数	63.33%		

●2017年7月4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7,000億円増の322兆7,000億円(当座預金残高見込みは361兆5,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態の調達で▲0.070~▲0.045%の出合いが中心となった。税揚げによる大幅不足日にあたるものの、資金調達ニーズの高まりは限定的で横ばい圏で推移した。一巡後は▲0.075~▲0.068%の調整の出合いが見られた。ターム物に関しては、引き続きショートターム物で▲0.04%近辺の出合い。

<レポ市場>

GC T/N(7/5-7/6)は▲0.060~▲0.050%程度、S/N(7/6-7/7)は▲0.060~0.055%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、3Mで▲0.097%の少額の出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先S/Nは低位横ばいで推移。発行市場は、一部大型の発行案件が見られたものの、発行総額は400億円程度にとどまった。発行レートは低位横ばいで推移。CP等買入オベがオファー額3,500億円を実施され、入札結果は平均落札レート0.006%・按分落札レート▲0.001%(平均▲0.002%、按分▲0.004%)と、前回比で共に上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/7/4	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	▲ 0.056				-	▲ 0.062	0.075	▲ 0.005	20,032.35	▲ 23.45	113.38-40	113.10-12
T/N							-	▲ 0.053						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.230	▲ 0.036				-	▲ 0.062						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.027				-	▲ 0.065						
3W							-	▲ 0.067						
1M							-	▲ 0.074						
3M							▲ 0.093	▲ 0.093						
6M							▲ 0.090	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.149						
									日付	6/27	6/28	6/29	6/30	7/3
									日銀当預残	3,622,400	3,624,900	3,625,100	3,629,500	3,628,500
									準備預金残	3,242,300	3,232,500	3,236,900	3,196,000	3,230,600
									マナタリーベース	4,670,800	4,673,800	4,675,300	4,680,400	4,678,800
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.051%	▲0.053%	▲0.069%	▲0.060%
									コール市場残高	95,429	91,188	91,744	78,649	82,981
									うち無担	75,798	71,153	72,130	60,244	62,115
									うちO/N	44,838	40,703	43,390	45,204	39,230
									うち有担	19,631	20,035	19,614	18,405	20,866

●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)
10年利付国債	347	0.10%	23,000	2017/7/6	2027/6/20	88,471.0	18,548.00	100.1900	0.0800%	58.2351%	100.2000	0.0790%	4,439.0

●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
CP等買入	3,500	2017/7/7			12,062	3479	▲0.001		0.006	99
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	45,689	2017/7/4	2017/7/5		550	550		▲0.600	▲0.600	

●2017年7月5日の予定

*7月の日銀当座預金増減要因見込み

*米国5月の製造業新規受注・出荷・在庫

*国庫短期証券(693回)入札(6ヶ月、26,000億円、7/10発行)
*交付税特別会計借入(10,500億円、7/13借入)

◆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