

Central Daily Market Report

2017年7月5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	2017年7月5日		2017年7月6日		2017年7月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 300	▲ 1,000			
財政	3,000	▲ 24,900	2,000			
資金過不足	3,100	▲ 25,200	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						
国債買入	8,900		10,300			
CP等買入		▲ 400	▲ 200	3,500		
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		500			
国債補完供給	▲ 200	600	200			
当預増減	12,200	▲ 24,700	14,800			
当座預金残高	3,625,500	3,600,800	3,615,600			
準備預金残高	3,237,700					
積み終了先	3,237,500			7月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,237,500			積数	1,500	
非準備預金先	387,800			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	99.95%	日数	66.67%		

●2017年7月5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1兆円増の323兆7,000億円(当座預金残高見込みは362兆6,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態の調達で▲0.065~▲0.045%の出合いが中心となった。▲0.055%で寄り付いた後は地銀業態を中心に資金調達希望が強く、前日比で小幅強含みで推移した。一巡後は▲0.070~▲0.050%の出合いが見られた。ターム物に関しては、特段の出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(7/6-7/7)は▲0.065~▲0.060%程度、S/N(7/7-7/10)は▲0.075~0.065%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。本日は6M物の入札が実施され、WI取引で▲0.105%の出合いが見られたこともあり、入札結果は平均落札利回▲0.1019%・按分落札利回▲0.1000%と、しっかりした結果となった。セカンダリー市場では、6Mが▲0.104~▲0.102%で推移した。

<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、発行総額は1,100億円程度まで膨らんだ。発行レートは横ばい圏での落ち着いた取引が見られた。

●短期金融市場関連指標

2017/7/5	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.063	0.080	0.005	20,081.63	49.28	112.97-98	113.48-50
T/N							-	▲ 0.063						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.068						
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.071						
3W			0.000				-	▲ 0.071						
1M							-	▲ 0.077						
3M							▲ 0.092	▲ 0.096						
6M							▲ 0.104	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.151						
									日付	6/28	6/29	6/30	7/3	7/4
									日銀当預残	3,624,900	3,625,100	3,629,500	3,628,500	3,613,300
									準備預金残	3,232,500	3,236,900	3,196,000	3,230,600	3,226,300
									マネタリーベース	4,673,800	4,675,300	4,680,400	4,678,800	4,663,700
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.053%	▲0.069%	▲0.060%	▲0.056%
									コール市場残高	91,188	91,744	78,649	82,981	83,830
									うち無担	71,153	72,130	60,244	62,115	63,694
									うちO/N	40,703	43,390	45,204	39,230	38,539
									うち有担	20,035	19,614	18,405	20,866	20,136

●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)
国庫短期証券	693	-	26,000	2017/7/10	2018/1/12	103,340.0	21,279.4	100.0510	▲0.1000%	70.4432%	100.0520	▲0.1019%	4,720.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/7/13	2018/1/15	150,737.0	10,500.04		0.0000%	7.0084%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/7/7			11,617	2,804	▲0.002		▲0.001	90.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/7/7			11,628	3,004	0.002		0.002	67.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/7/7			13,290	4,506	0.002		0.006	5.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	8,956	2017/7/5	2017/7/6		242	242		▲0.600	▲0.668	
米ドル資金供給		2017/7/7	2017/7/13	1.65	0	0				

●2017年7月6日の予定

*米国5月の貿易収支	*国庫短期証券(694回)入札 (3ヶ月、44,000億円、7/10発行)	*30年利付国債入札 (8,000億円、7/10発行)
*米国6月のISM非製造業景況指数		

◆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