

# Central Daily Market Report

2017年7月6日(木)

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6日		2017年7月7日		2017年7月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 300			2,000
財政	▲ 21,200		5,500			▲ 32,000
資金過不足	▲ 21,600		5,200			▲ 30,000
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					1,300	▲ 1,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,500			
CP等買入		▲ 200	3,500	▲ 200		
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	500		100			
国債補完供給	▲ 900	200		900		
当預増減	▲ 22,000		20,000			▲ 30,000
当座預金残高	3,603,500		3,623,500			3,593,500
準備預金残高	3,208,200					
積み終了先	3,208,000				7月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,208,000				積数	1,400
非準備預金先	395,300				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	70.00%		

## ●2017年7月6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3兆1000億円減の320兆6,000億円(当座預金残高見込みは360兆1,000億円)。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。都銀・信託業態で▲0.065%近辺、証券業態から▲0.05%近辺、地銀業態より▲0.065~▲0.045%の調達が見られた。一巡後もビッドが残る展開で同水準での出合いが散見された。ターム物に関しては、ショートタームで▲0.040%の出合い。固定金利方式による共通担保資金供給オペは2W物で8,000億円がオフアされた。結果は1,300億円の応札(期落ち分1,310億円)で未達となった。

### <レポ市場>

GC T/N(7/7-7/10)は▲0.080~▲0.075%程度、S/N(7/10-7/11)は▲0.090~▲0.070%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。本日実施された3M物の入札は、WI取引で▲0.098~▲0.097%とやや強目の出合いが見られたものの、入札結果は平均落札利回▲0.0955%・按分落札利回▲0.0912%と落ち着いた結果となった。セカンダリー市場では、▲0.093~▲0.0915%と小動きであった。その他には6M物で▲0.105~▲0.102%の出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額700億円弱に対して、発行総額は3,000億円強と大きく発行超となった。10日発行となり、機械・石油・鉄鋼業態で大型案件が見られ、比較的活況としたマーケットであった。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

2017/7/6	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	▲ 0.051				-	▲ 0.070	0.095	0.015	19,994.06	▲ 87.57	113.20-21	113.33-34
T/N							-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.078						
2W							-	▲ 0.078						
3W							-	▲ 0.077						
1M			▲ 0.005				-	▲ 0.080						
3M							▲ 0.091	▲ 0.097						
6M							▲ 0.104	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.151						
									日付	6/29	6/30	7/3	7/4	7/5
									日銀当預残	3,625,100	3,629,500	3,628,500	3,613,300	3,625,500
									準備預金残	3,236,900	3,196,000	3,230,600	3,226,300	3,237,700
									マネタリーベース	4,675,300	4,680,400	4,678,800	4,663,700	4,675,800
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.069%	▲0.060%	▲0.056%	▲0.054%
									コール市場残高	91,744	78,649	82,981	83,830	87,199
									うち無担	72,130	60,244	62,115	63,694	65,629
									うちO/N	43,390	45,204	39,230	38,539	40,189
									うち有担	19,614	18,405	20,866	20,136	21,570

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	694	-	44,000	2017/7/10	2017/10/10	171,507.0	35,648.2	100.0230	▲0.0912%	60.4912%	100.0241	▲0.0955%	8,351.0
30年利付国債	55	0.80%	8,000	2017/7/10	2047/6/20	23,526.0	6,500.00	98.0500	0.8820%	57.2512%	98.1400	0.8780%	1,491.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/7/10	2017/7/24		1,300	1300				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	12,599	2017/7/6	2017/7/7		919	919		▲0.600	▲0.605	

## ●2017年7月7日の予定

- \*5月の毎月勤労統計調査速報
- \*5月の景気動向指数速報
- \*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- \*米国6月の雇用統計

◆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