

Central Daily Market Report

2017年7月7日(金)

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7日		2017年7月10日		2017年7月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		900		2,000	
財政	8,700		▲ 30,800		▲ 1,000	
資金過不足	8,400		▲ 29,900		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			1,300	▲ 1,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入					15,000	
国債買入	10,500				8,000	
CP等買入	3,500	▲ 200		▲ 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	100					
国債補完供給	▲ 800	900		800		
当預増減	22,400		▲ 29,500		24,000	
当座預金残高	3,625,900		3,596,400		3,620,400	
準備預金残高	3,244,400					
積み終了先	3,244,300					
超過準備	3,244,300					
非準備預金先	381,500					
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					2,903,700	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	80.00%		

●2017年7月7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3兆7,000億円増の324兆3,000億円(当座預金残高見込みは362兆4,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀・証券業態の調達で▲0.060~▲0.040%の出合いとなった。都銀・信託業態で▲0.055%近辺、証券業態から▲0.055~▲0.050%近辺、地銀業態より▲0.060~▲0.035%の調達が見られた。週末の取引で資金調達ニーズは総じて堅調でレートは強含んだ。一巡後は調整から▲0.070~▲0.060%の出合い。ターム物に関しては、ショートタームで▲0.045%程度の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/10-7/11)は▲0.085~▲0.080%程度、S/N(7/11-7/12)は▲0.120~▲0.095%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。セカンダリー市場は、短国買入オペが予想よりも多めの1兆5,000億円でオファーされ、平均落札利回較差▲0.003%、按分落札利回較差▲0.007%と、順調な結果になった。オペがオファーされる前は3M物で▲0.095~▲0.093%、6M物で▲0.106~0.104%の出合いが見られていたが、オファーされた後は3M物で▲0.098~▲0.096%、6M物で▲0.106%の出合いと、若干低下した。

<CP市場>

現先S/Nは低位横ばいで推移。発行市場は案件乏しく閑散。発行レートは概ね横ばいでの取引となった。

●短期金融市場関連指標

2017/7/7	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.077	0.085	▲ 0.010	19,929.09	▲ 64.97	113.15-16	113.69-71
T/N							-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.015	▲ 0.037				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.089						
3M							▲ 0.092	▲ 0.098						
6M							▲ 0.105	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.151						
									日付	6/30	7/3	7/4	7/5	7/6
									日銀当預残	3,629,500	3,628,500	3,613,300	3,625,500	3,603,500
									準備預金残	3,196,000	3,230,600	3,226,300	3,237,700	3,208,200
									マネタリーベース	4,680,400	4,678,800	4,663,700	4,675,800	4,654,200
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.060%	▲0.056%	▲0.054%	▲0.051%
									コール市場残高	78,649	82,981	83,830	87,199	87,752
									うち無担	60,244	62,115	63,694	65,629	66,871
									うちO/N	45,204	39,230	38,539	40,189	40,866
									うち有担	18,405	20,866	20,136	21,570	20,881

●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	15,000	2017/7/11			29,751	15,002	▲0.007		▲0.003	96.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2017/7/11			15,528	5,010	▲0.009		▲0.008	77.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/7/11			2,167	2,000	▲0.028		0.014	33.0
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/7/11			2,136	1,002	0.021		0.035	9.9
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	21,974	2017/7/7	2017/7/10		759	759		▲0.600	▲0.619	
国債補完供給(国債売現先・即日(午後オファー分))	10,000	2017/7/7	2017/7/10		15	15		▲0.600	▲0.600	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)		2017/7/11			0	0				

※国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は0.015%。この結果、10年利付国債347回の買入利回りは、0.110%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2017年7月10日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)	*米国5月の消費者信用残高
*5月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+1.7%)	*米国6月のFRB労働市場情勢指数
*5月の国際収支	
*6月の景気ウォッチャー調査	

◆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