

# Central Daily Market Report

2017年7月10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10日		2017年7月11日		2017年7月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		300		1,000	
財政	▲ 32,300		▲ 2,300		▲ 15,000	
資金過不足	▲ 31,400		▲ 2,000		▲ 14,000	
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			15,000			
国債買入			8,200			
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入			100			
国債補完供給	▲ 1,500	800		1,500		
当預増減	▲ 32,500		22,400		▲ 14,000	
当座預金残高	3,593,400		3,615,800		3,601,800	
準備預金残高	3,204,200					
積み終了先	3,204,000					
超過準備	3,204,000					
非準備預金先	389,200					
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	99.97%	日数	83.33%		

## ●2017年7月10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3兆5,000億円減の320兆8,000億円(当座預金残高見込みは359兆6,000億円)。本日の無担O/N物は▲0.050%で寄り付き後、邦銀、証券業態の調達で▲0.055~▲0.040%が出合いの中心となった。先週末に引き続き資金調達ニーズは堅調で、一巡後も▲0.060~▲0.040%で散発的にビッドが入り、出合いが見られた。ターム物に関しては、特段出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(7/11-7/12)は▲0.090~▲0.085%程度、S/N(7/12-7/13)は▲0.090~0.085%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、10Y333~347、20Y155~161などにビッドの出入りが多く見られた。

### <短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移。市場に目立った材料はなく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、償還総額50億円程度に対して、発行総額は900億円程度と発行超。一部の卸売業態で大型案件が見られたものの、案件数は少なく、やや閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/7/10	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.083	0.090	0.005	20,080.98	151.89	113.97-98	114.17-18
T/N							-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.046	▲ 0.015	▲ 0.036				-	▲ 0.092						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.090						
3W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.029				-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.092						
3M			▲ 0.035				▲ 0.093	▲ 0.099						
6M							▲ 0.104	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.151						
									日付	7/3	7/4	7/5	7/6	7/7
									日銀当預残	3,628,500	3,613,300	3,625,500	3,603,500	3,625,900
									準備預金残	3,230,600	3,226,300	3,237,700	3,208,200	3,244,400
									マネタリーベース	4,678,800	4,663,700	4,675,800	4,654,200	4,676,900
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.056%	▲0.054%	▲0.051%	▲0.050%
									コール市場残高	82,981	83,830	87,199	87,752	95,191
									うち無担	62,115	63,694	65,629	66,871	74,275
									うちO/N	39,230	38,539	40,189	40,866	48,070
									うち有担	20,866	20,136	21,570	20,881	20,916

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	51,516	2017/7/10	2017/7/11		1,453	1,453		▲0.600	▲0.632	

## ●2017年7月11日の予定

*5月の特定サービス産業動態統計速報	*米国5月の卸売売上高	*5年利付国債入札(22,000億円、7/13発行)
*6月のマネーストック		*エネルギー対策借入(7,000億円、7/20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