

Central Daily Market Report

2017年7月12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12日		2017年7月13日		2017年7月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 10,200		▲ 24,200		3,000	
資金過不足	▲ 10,000		▲ 25,000		2,000	
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					11,100	
CP等買入		▲ 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		▲ 100				
E T F買入			100			
国債補完供給	▲ 1,100	1,800		1,100		
当預増減	▲ 9,600		▲ 24,200		13,100	
当座預金残高	3,602,400		3,578,200		3,591,300	
準備預金残高	3,220,700					
積み終了先	3,220,500					7月13日以降の残り所要積立額
超過準備	3,220,500					積数
非準備預金先	381,700					1日平均
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	99.99%	日数	90.00%		

●2017年7月12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2,000億円増の322兆4,000億円(当座預金残高見込みは360兆2,000億円)。本日の無担O/N物は税揚げ日に当たり邦銀、証券業態の調達で▲0.050~▲0.035%の出会いと引き続き堅調な展開となった。一巡後も大手行中心に資金調達ニーズが厚く▲0.050%程度で調整の出会いが見られた。ターム物に関しては、特段の出会いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(7/13-7/14)は▲0.085~▲0.080%程度、S/N(7/14-7/18)は▲0.090~▲0.075%程度での出会い。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。閑散な地合いの中、店頭での買いからか3M物で▲0.12%、6M物で▲0.112~▲0.11%の散発的な出会いが見られた。

<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1,000億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と発行超。ゴム製品・不動産・石油業態からの大型案件が見られたものの、概ね落ち着いたマーケットとなった。発行レートは横ばいで推移した。また、CP等買入才べが、前回と同額の3,500億円でオファーされ、入札結果は平均落札レート0.009%・按分レート▲0.001%と、前回(平均0.006%・按分▲0.001%)比で平均レートが若干上昇した。

●短期金融市場関連指標

2017/7/12	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	▲ 0.044				-	▲ 0.086	0.085	▲ 0.005	20,098.38	▲ 97.10	113.75-76	113.44-46
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.093						
2W							-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.092						
1M			▲ 0.009				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.096	▲ 0.100						
6M							▲ 0.108	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.093	▲ 0.151						
									日付	7/5	7/6	7/7	7/10	7/11
									日銀当預残	3,625,500	3,603,500	3,625,900	3,593,400	3,612,000
									準備預金残	3,237,700	3,208,200	3,244,400	3,204,200	3,221,600
									マネタリーベース	4,675,800	4,654,200	4,676,900	4,643,500	4,661,800
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.051%	▲0.050%	▲0.050%	▲0.048%
									コール市場残高	87,199	87,752	95,191	91,161	90,423
									うち無担	65,629	66,871	74,275	71,104	70,905
									うちO/N	40,189	40,866	48,070	45,824	45,355
									うち有担	21,570	20,881	20,916	20,057	19,518

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/7/14			10,516	2,803	▲0.006		▲0.004	17.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/7/14			12,183	3,303	▲0.004		▲0.003	78.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2017/7/14			17,132	5,006	▲0.002		▲0.001	73.8
CP等買入	3,500	2017/7/18			11,597	3,489	▲0.001		0.009	58.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	9,020	2017/7/12	2017/7/13		1,077	1,077		▲1.500	▲2.057	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	16,372	2017/7/12	2017/7/13		50	50		▲0.500	▲0.500	

●2017年7月13日の予定

*米国6月の財政収支	*国庫短期証券(695回)入札 (3ヶ月、44,000億円、7/18発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、7/24借入)
*米国6月の生産者物価指数	*20年利付国債入札 (10,000億円、7/18発行)	

◆本資料は信頼できるとさ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