

# Central Daily Market Report

2017年7月14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14日		2017年7月18日		2017年7月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		400		1,000	
財政	3,800		▲ 28,500		5,000	
資金過不足	3,000		▲ 28,100		6,000	
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			1,600	▲ 1,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					7,500	
国債買入	11,200				9,100	
CP等買入		▲ 400	3,500	▲ 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		▲ 100				
E T F買入	100		300			
国債補完供給	▲ 700	800		700		
当預増減	13,900		▲ 24,100		22,600	
当座預金残高	3,590,900		3,566,800		3,589,400	
準備預金残高	3,193,300					
積み終了先	3,193,300				7月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,193,200				積数	164,100
非準備預金先	397,600				1日平均	5,700
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額						2,999,300
準備預金進捗率	実績	94.53%	日数	6.45%		

## ●2017年7月14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9,000億円減の319兆8,000億円(当座預金残高見込みは359兆2,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態の調達で▲0.045~▲0.035%が出合いの中心となった。積み最終日に当たったものの、次の積み期間に係る取引のため取り上がる動きは限定的で、前日比横ばい圏で推移した。一巡後は▲0.070~▲0.045%で散発的に調整の出合いがあった。後場は目立った動きは見られなかった。ターム物に関しては、ショートタームで▲0.040%近辺の出合い。

### <レポ市場>

GC T/N(7/18-7/19)は▲0.100~▲0.080%程度、S/N(7/19-7/20)は▲0.095~▲0.090%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T/Nは低水準で推移。短国買入オペアが7,500億円でオファーされ、平均落札利回較差▲0.002%、按分落札利回較差▲0.003%と、落ち着いた結果となった。その後は3M・6M物共に▲0.115%で少額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。発行市場は、償還総額400億円弱に対して、発行総額は1,000億円強と若干の発行超。一部の小売業態で大型案件は見られたものの、小型案件が中心となる落ち着いたマーケットであった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/7/14	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.064	0.075	0.000	20,118.86	19.05	113.42-43	113.28-29
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.042	▲ 0.033	▲ 0.039				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.037				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.114	▲ 0.105						
6M							▲ 0.106	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.094	▲ 0.151						
									日付	7/7	7/10	7/11	7/12	7/13
									日銀当預残	3,625,900	3,593,400	3,612,000	3,602,400	3,577,000
									準備預金残	3,244,400	3,204,200	3,221,600	3,220,700	3,209,300
									マネタリーベース	4,676,900	4,643,500	4,661,800	4,652,100	4,627,400
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.050%	▲0.048%	▲0.044%	▲0.040%
									コール市場残高	95,191	91,161	90,423	84,961	83,991
									うち無担	74,275	71,104	70,905	65,579	64,877
									うちO/N	48,070	45,824	45,355	39,809	39,567
									うち有担	20,916	20,057	19,518	19,382	19,114

## ●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	応募総額(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	7,500	2017/7/19			19,981	7,502	▲0.003		▲0.002	40.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/7/19			11,778	2,802	0.008		0.009	24.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/7/19			9,778	3,307	0.006		0.006	88.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/7/19			5,446	2,001	0.002		0.009	80.3
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/7/19			4,151	1,003	0.015		0.016	62.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	13,043	2017/7/14	2017/7/18		673	673		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/7/14	2017/7/18		0	0				

## ●2017年7月17日の予定

\* 海の日

\*ユーロ圏6月の消費者物価指数改定値

## ●2017年7月18日の予定

\*英国6月の消費者物価指数

\*国庫短期証券(696回)入札  
(1年、23,000億円、7/20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