

Central Daily Market Report

2017年7月18日(火)

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18日		2017年7月19日		2017年7月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		600		▲ 1,000	
財政	▲ 28,000		▲ 100		▲ 16,000	
資金過不足	▲ 27,500		500		▲ 17,000	
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			9,300		6,300	
CP等買入	3,500	▲ 500		▲ 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	300		400			
国債補完供給	▲ 100	700		100		
当預増減	▲ 23,600		17,400		▲ 10,700	
当座預金残高	3,567,300		3,584,700		3,574,000	
準備預金残高	3,165,000					
積み終了先	3,122,400		7月19日以降の残り所要積立額		積数 72,200	
超過準備	3,073,100		1日平均		2,600	
非準備預金先	402,300					
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		97.59%		日数 9.68%	

●2017年7月18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2兆7,000億円減少の317兆1,000億円(当座預金残高見込みは356兆7,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態などから▲0.075~▲0.07%、地銀業態から▲0.07~▲0.05%近辺の調達希望で始まった。積み期間の前半であることから、各業態とも調達意欲は限定的で、朝方の出会いの水準は▲0.07~▲0.04%、一巡後は▲0.075~▲0.06%の出会いが中心となった。ターム物は閑散な地合いだった。

<レポ市場>

GC T/N(7/19-7/20)は▲0.085~▲0.070%程度、S/N(7/20-7/21)は▲0.090~▲0.075%程度での出会い。資金調達・運用ニーズが共に厚くなく、閑散小動きの地合いとなっている。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S/Nは、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引で▲0.115%での出会いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1158%、按分落札利回▲0.1138%と堅調な結果となった。セカンダリー市場では、▲0.113%で出合った。また、3M物が▲0.115~▲0.1125%で出合った。

<CP市場>

現先レートは、引き続き低位で推移した。CP発行市場は、五・十日発行に該当し、不動産業態等から大型発行が実施されるなど、幅広い業態から発行があった。発行総額は1,700億円弱とやや膨らんだ。発行レートは、一部上昇する銘柄は見られたものの、引き続き0%近辺での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2017/7/18	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	▲ 0.054				-	▲ 0.087	0.065	▲ 0.010	19,999.91	▲ 118.95	112.60-61	112.23-24
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.040	0.010	▲ 0.026				-	▲ 0.096						
3W	▲ 0.033	0.000	▲ 0.022				-	▲ 0.097						
1M							-	▲ 0.101						
3M			▲ 0.040				▲ 0.114	▲ 0.109						
6M							▲ 0.105	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.114	▲ 0.151						
日付		7/10	7/11	7/12	7/13	7/14								
日銀当預残		3,593,400	3,612,000	3,602,400	3,577,000	3,590,900								
準備預金残		3,204,200	3,221,600	3,220,700	3,209,300	3,193,300								
マネタリーベース		4,643,500	4,661,800	4,652,100	4,627,400	4,642,100								
無担O/N加重平均		▲ 0.050%	▲ 0.048%	▲ 0.044%	▲ 0.040%	▲ 0.042%								
コール市場残高		91,161	90,423	84,961	83,991	85,931								
うち無担		71,104	70,905	65,579	64,877	66,608								
うちO/N		45,824	45,355	39,809	39,567	42,908								
うち有担		20,057	19,518	19,382	19,114	19,323								

●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)	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	696	-	23,000	2017/7/20	2018/7/20	82,062.0	18,832.40	100.1140	▲0.1138%	78.6594%	100.1160	▲0.1158%	4,167.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2017/7/20			4,851	1,002	0.013		0.016	58.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2017/7/20			17,601	5,007	▲0.008		▲0.007	62.5
国債買入(物価連動債)	250	2017/7/20			1,603	251	▲0.240		▲0.305	73.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	54,440	2017/7/18	2017/7/19		54	54		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/7/20	2017/7/27	1.65	0	0				

●2017年7月19日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(1日目、20日まで)	*国庫短期証券(697回)入札(3ヶ月、44,000億円、7/24発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、7/27借入)
*米国6月の住宅着工件数	*流動性供給入札(3,000億円、7/21発行)	

◆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