

Central Daily Market Report

2017年7月21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21日		2017年7月24日		2017年7月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 200			0
財政	▲ 300		▲ 700			▲ 4,000
資金過不足	▲ 600		▲ 900			▲ 4,000
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						
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	1,100	▲ 1,100				
社債等買入						
E T F買入			700			
国債補完供給		300				
当預増減	▲ 500		▲ 400			11,000
当座預金残高	3,574,700		3,574,300			3,585,300
準備預金残高	3,167,600					
積み終了先	3,165,600				7月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,163,200				積数	13,100
非準備預金先	407,100				1日平均	600
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	99.56%	日数	25.81%		

●2017年7月21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2,000億円減少の317兆2,000億円(当座預金残高見込みは357兆4,000億円)。本日の無担O/N物は、信託・証券業態などから▲0.075~▲0.055%、地銀業態から▲0.075~▲0.04%近辺の調達希望で始まった。週末要因による取り上がりの動きは特に見られず、朝方の出合いの水準は、昨日までとほぼ同様の▲0.07~▲0.045%。一巡後は▲0.075~▲0.07%の出合いが中心となった。ターム物は閑散な地合いだった。

<レポ市場>

GC T/N(7/24-7/25)は▲0.090~▲0.080%程度、S/N(7/25-7/26)は▲0.095~▲0.090%程度での出合い。短国買入オペがオファーされた影響からやや資金調達サイドが引いた動きとなったものの、レート水準に大きな動きは見られなかった。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、小幅低下した。アウトライト市場では、短国買入オペが事前予想通りの1兆5,000億円(前日比+7,500億円)で実施された。結果は、平均落札利回較差▲0.010%、按分落札利回較差▲0.019%と好需給を反映した強めの結果となった。マーケットでは、短国買入オペの結果が出る前に3M物が▲0.130~▲0.128%、6M物が▲0.123%、1Y物が▲0.121~▲0.117%で出合った。結果が出た後は、1Y物が▲0.121~▲0.120%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、商社・住宅業態等から大型発行が実施された。発行総額は2,000億円弱となり、償還総額の1,000億円程度を上回った。発行はやや膨らんだものの、投資家の底堅い運用ニーズを受けて、発行レートは0%近辺での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2017/7/21	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.055				-	▲ 0.083	0.065	▲ 0.005	20,099.75	▲ 44.84	111.89-90	111.74-75
T/N							-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.042				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.042				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.101						
1M			0.001				-	▲ 0.103						
3M			0.380				▲ 0.126	▲ 0.111						
6M							▲ 0.119	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.122	▲ 0.151						
									日付	7/13	7/14	7/18	7/19	7/20
									日銀当預残	3,577,000	3,590,900	3,567,300	3,584,500	3,575,200
									準備預金残	3,209,300	3,193,300	3,165,000	3,188,400	3,170,500
									マネタリーベース	4,627,400	4,642,100	4,617,900	4,634,400	4,625,300
									無担O/N加重平均	▲0.040%	▲0.042%	▲0.055%	▲0.055%	▲0.056%
									コール市場残高	83,991	85,931	86,247	84,014	86,983
									うち無担	64,877	66,608	66,699	63,078	66,045
									うちO/N	39,567	42,908	43,249	39,518	41,235
									うち有担	19,114	19,323	19,548	20,936	20,938

●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)
流動性供給	242	-	5,500	2017/7/25		20,323.0	5,467.00		▲0.0070%	56.4435%		▲0.0080%	

●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	15,000	2017/7/25			26,137	15,001	▲0.019		▲0.010	50.7
社債等買入	1,500	2017/7/27			4186	1500	0.047		0.052	49.6

●2017年7月24日の予定

**5月の景気動向指数改訂状況

*米国6月の中古住宅販売

◆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。

◆本資料は何ら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