

# Central Daily Market Report

2017年7月24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24日		2017年7月25日		2017年7月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 200		▲ 1,000	
財政	▲ 1,600		3,400		3,000	
資金過不足	▲ 1,900		3,200		2,000	
<b>金融調節</b>	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					10,800	
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入				▲ 600		
E T F買入	700					
国債補完供給						
当預増減	▲ 1,400		17,400		12,800	
当座預金残高	3,573,300		3,590,700		3,603,500	
準備預金残高	3,170,400					
積み終了先	3,168,200		7月25日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,168,200		積数		10,900	
非準備預金先	402,900		1日平均		500	
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	99.64%	日数	29.03%		

## ●2017年7月24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7,000億円増加の317兆9,000億円(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~▲0.045%近辺の調達希望で始まった。週が変わっても各業態の調達姿勢にはあまり変化が見られず、朝方は▲0.07~▲0.045%の水準での出会い。一巡後は▲0.075~▲0.07%の出会いが中心となった。ターム物は1W物程度のショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(7/25-7/26)は▲0.09~▲0.08%程度、S/N(7/26-7/27)は▲0.09~▲0.085%程度での出会いとなった。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T/Nは、低位横ばいで推移した。アウトライト市場は、3Mが▲0.138~▲0.129%で小額の出合いが散発的に見られた程度で、様子見閑散なマーケットであった。

### <CP市場>

現先レートは、引き続き低位で推移した。発行市場は商社、小売業態等から大型の発行が見られ、総額2,400億円程度に達した。発行レートは概ね0%近辺での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/7/24	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.058				-	▲ 0.085	0.065	0.000	19,975.67	▲ 124.08	110.93-94	110.81-82
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.043	▲ 0.030	▲ 0.039				-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.040				-	▲ 0.100						
3W			0.000				-	▲ 0.100						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.128	▲ 0.110						
6M							▲ 0.121	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.123	▲ 0.151						
									日付	7/14	7/18	7/19	7/20	7/21
									日銀当預残	3,590,900	3,567,300	3,584,500	3,575,200	3,574,700
									準備預金残	3,193,300	3,165,000	3,188,400	3,170,500	3,167,600
									マネタリーベース	4,642,100	4,617,900	4,634,400	4,625,300	4,625,300
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.055%	▲0.055%	▲0.056%	▲0.055%
									コール市場残高	85,931	86,247	84,014	86,983	86,234
									うち無担	66,608	66,699	63,078	66,045	65,620
									うちO/N	42,908	43,249	39,518	41,235	39,870
									うち有担	19,323	19,548	20,936	20,938	20,614

## ●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	2017/7/26			12,334	2,802	0.003		0.004	47.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/7/26			9,445	3,304	▲0.003		▲0.001	92.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,700	2017/7/26			13,877	4,708	0.000		0.001	48.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/7/24	2017/7/25		45	45		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年7月25日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(6月15、16日分)	*米国FOMC(1日目)	*40年利付国債入札(5,000億円、7/27発行)
	*米国5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
	*米国7月のCB消費者信頼感指数	

◆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