

Central Daily Market Report

2017年7月25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25日 | | 2017年7月26日 | | 2017年7月27日 | |
|-----------------------|------------|--------|------------|--------|------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 300 | | ▲ 600 | | ▲ 2,000 | |
| 財政 | 3,000 | | 700 | | ▲ 3,000 | |
| 資金過不足 | 2,700 | | 100 | | ▲ 5,000 | |
| 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 | 15,000 | | | | | |
| 国債買入 | | | 10,900 | | | |
| 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 | | ▲ 300 | 1,500 | |
| E T F 買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 600 | | | 600 | | |
| 当預増減 | 16,300 | | 11,100 | | ▲ 3,500 | |
| 当座預金残高 | 3,589,600 | | 3,600,700 | | 3,597,200 | |
| 準備預金残高 | 3,179,300 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,178,900 | | | | | |
| 超過準備 | 3,178,400 | | | | | |
| 非準備預金先 | 410,300 | | | | | |
| 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 | 99.67% | 日数 | 32.26% | | |

●2017年7月25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6,000億円増加の318兆5,000億円(当座預金残高見込みは359兆1,000億円)。本日の無担O/N物は、信託・証券業態などから▲0.075~▲0.06%、地銀業態から▲0.08~▲0.045%近辺の調達希望で始まった。昨日までと同様、各業態の資金調達意欲は低調で、朝方は▲0.08~▲0.045%のレンジでの出会い。一巡後も取り上がる先は現れず、▲0.08~▲0.07%の出会いが中心となった。ターム物はロール案件の取引が中心となった。

<レポ市場>

GC T/N(7/26-7/27)は▲0.09~▲0.085%程度、S/N(7/27-7/28)は▲0.09~▲0.085%程度での出会いとなった。大きな需給要因もなく、昨日と横ばいでのレート推移となった。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5Y127~132、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物が▲0.155~▲0.145%、6M物が▲0.150~▲0.145%で散発的に出合った程度と、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。発行市場はノンバンク、紙パルプ業態等から大型の発行が見られ、100億円の償還に対して、発行は1,000億円程度と発行超のマーケットとなった。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

| 2017/7/25 | 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 | ▲ 0.060 | | | | - | ▲ 0.088 | 0.065 | 0.000 | 19,955.20 | ▲ 20.47 | 111.24-25 | 111.19-22 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.089 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | | | 0.001 | | | | - | ▲ 0.102 | | | | | | |
| 2W | | | 0.001 | | | | - | ▲ 0.100 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.100 | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.041 | | | | - | ▲ 0.102 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.133 | ▲ 0.111 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.124 | ▲ 0.124 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.126 | ▲ 0.150 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 7/18 | 7/19 | 7/20 | 7/21 | 7/24 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,567,300 | 3,584,500 | 3,575,200 | 3,574,700 | 3,573,300 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,165,000 | 3,188,400 | 3,170,500 | 3,167,600 | 3,170,400 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,617,900 | 4,634,400 | 4,625,300 | 4,625,300 | 4,624,100 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.055% | ▲0.055% | ▲0.056% | ▲0.055% | ▲0.058% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 86,247 | 84,014 | 86,983 | 86,234 | 85,968 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 66,699 | 63,078 | 66,045 | 65,620 | 65,428 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 43,249 | 39,518 | 41,235 | 39,870 | 39,368 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 19,548 | 20,936 | 20,938 | 20,614 | 20,540 |

●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) |
|---------|----|-------|-------|-----------|-----------|----------|----------|-------|-------------|---------|--------|-------------|---------------|
| 40年利付国債 | 10 | 0.90% | 5,000 | 2017/7/27 | 2057/3/20 | 15,971.0 | 4,993.00 | | 1.0450% | 6.5217% | | | |

●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 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 26,501 | 2017/7/25 | 2017/7/26 | | 592 | 592 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |
| 米ドル資金供給 | | 2017/7/27 | 2017/8/3 | 1.65 | 0 | 0 | | | | |

●2017年7月26日の予定

*広島県金融経済懇談会にて中曽副総裁講演
*6月の企業向けサービス価格指数

*米FOMC(2日目)
*米国6月の新築一戸建て販売件数
*英国4-6月期のGDP速報値

*交付税特別会計借入
(10,500億円、8/3借入)

◆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