

Central Daily Market Report

2017年7月26日(水)

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26日		2017年7月27日		2017年7月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 1,400		▲ 2,000	
財政	1,500		▲ 7,300		1,000	
資金過不足	800		▲ 8,700		▲ 1,000	
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						
国債買入	10,900				4,000	
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300	1,500	▲ 100		
E T F買入			700			
国債補完供給	▲ 200	600		200		
当預増減	11,600		▲ 6,500		3,000	
当座預金残高	3,601,200		3,594,700		3,597,700	
準備預金残高	3,190,600					
積み終了先	3,190,200		7月27日以降の残り所要積立額		積数 9,600	
超過準備	3,190,200		1日平均		500	
非準備預金先	410,600					
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					2,999,500	
準備預金進捗率	実績	99.68%	日数	35.48%		

●2017年7月26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1兆円増加の319兆5,000億円(当座預金残高見込みは360兆1,000億円)。本日の無担O/N物は、信託・証券業態などから▲0.08~▲0.06%、地銀業態から▲0.08~▲0.045%近辺の調達希望で始まった。相変わらず参加者の調達意欲は限定的で、朝方は▲0.08~▲0.045%の幅広いレンジでの出会い。一巡後もビッド状況にはあまり変化が無く、▲0.08~▲0.075%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(7/27-7/28)は▲0.09~▲0.085%程度、S/N(7/28-7/31)は▲0.085~▲0.08%程度での出会いとなった。S/Nは投資家のまとまった資金調達が見られた。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物の入札(27日オファー)を控え、動意なく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、鉄鋼、電力、機械業態等から大型の発行が見られ、発行額は3,000億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね0%近辺での推移となった。またCP等買入オベが3,500億円でおファーされ、結果は平均落札レート0.003% 按分落札レート▲0.002%と、応札額が少なかったことから前日比(平均0.009% 按分▲0.001%)低下する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/7/26	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	▲ 0.060				-	▲ 0.089	0.075	0.010	20,050.16	94.96	112.01-02	111.83-85
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.028				-	▲ 0.101						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.100						
1M			0.000				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.129	▲ 0.110						
6M							▲ 0.123	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.150						
									日付	7/19	7/20	7/21	7/24	7/25
									日銀当預残	3,584,500	3,575,200	3,574,700	3,573,300	3,589,600
									準備預金残	3,188,400	3,170,500	3,167,600	3,170,400	3,179,300
									マネタリーベース	4,634,400	4,625,300	4,625,300	4,624,100	4,640,700
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.056%	▲0.055%	▲0.058%	▲0.060%
									コール市場残高	84,014	86,983	86,234	85,968	88,179
									うち無担	63,078	66,045	65,620	65,428	67,724
									うちO/N	39,518	41,235	39,870	39,368	41,619
									うち有担	20,936	20,938	20,614	20,540	20,455

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/8/3	2018/2/1	132,607.0	10,500.04		0.0000%	7.9816%		0.0000%	

●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	2017/7/28			3,807	1,006	0.001		0.002	76.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/7/28			8,353	2,011	0.007		0.008	63.9
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/7/28			3,059	1,001	0.004		0.008	72.0
CP等買入	3,500	2017/7/31			5,254	3,492	▲0.002		0.003	52.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	12,463	2017/7/26	2017/7/27		172	172		▲0.600	▲0.600	

●2017年7月27日の予定

*米国6月の耐久財新規受注

*国庫短期証券(698回)入札
(3ヶ月、44,000億円、7/31発行)

*2年利付国債入札
(22,000億円、8/15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