

Central Daily Market Report

2017年7月31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31日 | | 2017年8月1日 | | 2017年8月2日 | |
|-----------------------|------------|---------|-----------|--------|--|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 300 | | 100 | | 1,000 | |
| 財政 | 30,800 | | ▲ 5,000 | | ▲ 49,000 | |
| 資金過不足 | 31,100 | | ▲ 4,900 | | ▲ 48,000 | |
| 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 | 1,700 | ▲ 1,800 | | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | 5,000 | | | |
| 国債買入 | | | 10,900 | | 3,300 | |
| CP等買入 | 3,500 | ▲ 1,500 | | ▲ 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 | | ▲ 100 | | | | |
| E T F買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 100 | 100 | | 100 | | |
| 当預増減 | 32,900 | | 11,000 | | ▲ 44,700 | |
| 当座預金残高 | 3,629,300 | | 3,640,300 | | 3,595,600 | |
| 準備預金残高 | 3,222,500 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,221,700 | | | | | |
| 超過準備 | 3,221,700 | | | | 8月1日以降の残り所要積立額 積数 7,000 1日平均 500 | |
| 非準備預金先 | 406,800 | | | | | |
| 積み期間(7/16~8/15)の所要準備額 | | | | | 2,996,200 | |
| 準備預金進捗率 | 実績 | 99.77% | 日数 | 51.61% | | |

●2017年7月31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4兆6,000億円増加の323兆円(当座預金残高見込みは363兆円)。本日の無担O/N物は、都銀業態から▲0.086%、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。月末日のため調達を控える先も散見されたため全体的に調達意欲は低く、朝方は▲0.08~▲0.045%の幅広いレンジでの出会い。一巡後は▲0.08~▲0.05%のレンジで推移した。ターム物はロール案件の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(8/1-8/2)は▲0.09~▲0.08%程度、S/N(8/2-8/3)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、10Y335~347、20Y158~161、30Y55などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライト市場は特段の出会いも見られず閑散だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は鉄鋼、商社業態からまとまった発行が見られ総額1,000億円程度に達した。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

| 2017/7/31 | 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 | ▲ 0.086 | 0.001 | ▲ 0.064 | | | | - | ▲ 0.081 | 0.073 | 0.003 | 19,925.18 | ▲ 34.66 | 110.49-51 | 110.62-64 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.083 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.045 | 0.001 | ▲ 0.035 | | | | - | ▲ 0.090 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.040 | ▲ 0.035 | ▲ 0.039 | | | | - | ▲ 0.091 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.097 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.102 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.131 | ▲ 0.109 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.120 | ▲ 0.123 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.121 | ▲ 0.150 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 7/24 | 7/25 | 7/26 | 7/27 | 7/28 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,573,300 | 3,589,600 | 3,601,200 | 3,594,300 | 3,596,400 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,170,400 | 3,179,300 | 3,190,600 | 3,181,900 | 3,191,600 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,624,100 | 4,640,700 | 4,653,100 | 4,647,700 | 4,650,900 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.058% | ▲ 0.060% | ▲ 0.060% | ▲ 0.063% | ▲ 0.063% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 85,968 | 88,179 | 87,925 | 87,947 | 92,223 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 65,428 | 67,724 | 67,168 | 67,116 | 70,840 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 39,368 | 41,619 | 40,833 | 41,366 | 45,710 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 20,540 | 20,455 | 20,757 | 20,831 | 21,383 |

●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10年超25年以下) | 2,000 | 2017/8/2 | | | 8,260 | 2,012 | 0.002 | | 0.004 | 9.8 |
| 国債買入(残存期間25年超) | 1,000 | 2017/8/2 | | | 3,743 | 1,007 | 0.003 | | 0.003 | 64.4 |
| 国債買入(物価連動債) | 250 | 2017/8/2 | | | 1,575 | 252 | ▲ 0.230 | | ▲ 0.265 | 35.0 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 30,000 | 2017/7/31 | 2017/8/1 | | 116 | 116 | | ▲ 0.600 | ▲ 0.600 | |

●2017年8月1日の予定

| | | |
|------------------|--------------------|-------------------------------|
| *米国6月の個人所得・消費支出 | *ユーロ圏4-6月期のGDP1次速報 | 10年利付国債入札 (23,000億円、8/3発行) |
| *米国6月の建設支出 | | 交付税特別会計借入 (10,500億円、8/9借入) |
| *米国7月のISM製造業景況指数 | | |

◆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