

Central Daily Market Report

2017年6月30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6月30日		2017年7月3日		2017年7月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		600		2,000	
財政	▲ 200		▲ 4,900		▲ 32,000	
資金過不足	▲ 900		▲ 4,300		▲ 30,000	
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			1,600	▲ 1,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					7,500	
国債買入	9,100				4,800	
CP等買入	3,500	▲ 5,000		▲ 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	500					
国債補完供給	▲ 2,800	100		2,800		
当預増減	4,400		▲ 1,800		▲ 17,700	
当座預金残高	3,629,500		3,627,700		3,610,000	
準備預金残高	3,196,000					
積み終了先	3,195,900		7月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,195,300		積数		2,100	
非準備預金先	433,500		1日平均		200	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					2,893,900	
準備預金進捗率	実績		99.93%		日数	
					56.67%	

●2017年6月30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1兆6,000億円減少の322兆円(当座預金残高見込みは363兆2,000億円)。本日の無担O/N物は都銀業態より▲0.086%、信託業態より▲0.08%、証券業態より▲0.08~▲0.065%、地銀業態より▲0.06~▲0.055%での調達で始まった。四半期末日にあたることから全体的に調達意欲は弱く、一巡後も朝方と同水準のレートで調整程度の出合いが数件見られる程度で、今月の取引を終えた。ターム物に関しては、7月スタートのショートターム物で▲0.04%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/3-7/4)は▲0.06~▲0.05%程度、S/N(7/4-7/5)は▲0.050%程度を中心とした出合い。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、10Y334~347、20Y155~161などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先S/N物は引き続き低位で推移した。本日は、短国買入オベが事前予想通りの7,500億円でオファーされた。結果は、平均利回較差+0.0000%、按分利回較差▲0.002%とこじっかりだった。順調なオベ結果を受けてか、後場は3M物が▲0.098%まで買い進まれた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、鉄鋼、石油・石炭製品、卸売業態等でまとまった額の調達が行われ、償還総額400億円弱に対し、発行総額は1,600億円弱と発行超となった。発行レートは、残高が積みあがっている銘柄で僅かに上昇する動きが見られたものの、全体としては引続き0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/6/30	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考総計値	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	▲ 0.069				-	▲ 0.112	0.084	0.029	20,033.43	▲ 186.87	112.01-02	112.05-07
T/N			0.000				-	▲ 0.054						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.039				-	▲ 0.070						
2W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.044				-	▲ 0.072						
3W							-	▲ 0.074						
1M							-	▲ 0.079						
3M			▲ 0.010				▲ 0.095	▲ 0.098						
6M							▲ 0.094	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.092	▲ 0.155						
									日付	6/23	6/26	6/27	6/28	6/29
									日銀当預残	3,616,000	3,604,800	3,622,400	3,624,900	3,625,100
									準備預金残	3,235,100	3,223,500	3,242,300	3,232,500	3,236,900
									マネタリーベース	4,663,100	4,652,400	4,670,800	4,673,800	4,675,300
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.053%	▲0.050%	▲0.051%	▲0.053%
									コール市場残高	99,460	91,925	95,429	91,188	91,744
									うち無担	76,352	72,184	75,798	71,153	72,130
									うちO/N	45,772	40,674	44,838	40,703	43,390
									うち有担	23,108	19,741	19,631	20,035	19,614

●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	7,500	2017/7/4			16,988	7,502	▲0.002		0.000	45.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/7/4			16,888	4,512	0.014		0.016	4.0
国債買入(物価連動債)	250	2017/7/4			1,154	251	▲0.170		▲0.181	95.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	88,963	2017/6/30	2017/7/3		2,772	2,772		▲0.600	▲0.600	

●2017年7月3日の予定

*6月の消費動向調査	*米国5月の建設支出
*7月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*米国6月のISM製造業景況指数
市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+15	

◆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