

Central Daily Market Report

2017年7月11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11日		2017年7月12日		2017年7月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		200		▲ 1,000	
財政	▲ 4,300		▲ 12,100		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 4,000		▲ 11,900		▲ 24,000	
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	8,200					
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 100		▲ 100		
E T F買入	100					
国債補完供給	▲ 1,800	1,500		1,800		
当預増減	18,600		▲ 10,400		▲ 24,000	
当座預金残高	3,612,000		3,601,600		3,577,600	
準備預金残高	3,221,600					
積み終了先	3,221,500		7月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,221,500		積数		700	
非準備預金先	390,400		1日平均		200	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					2,903,700	
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	86.67%		

●2017年7月11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1兆4,000億円増の322兆2,000億円(当座預金残高見込みは361兆6,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態の調達で▲0.050~▲0.040%が出合いの中心となった。一巡後も▲0.055~▲0.040%で散発的な出合いが見られた後、後場は調整から▲0.065%が出合い、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートタームで▲0.040%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/12-7/13)は▲0.090~▲0.085%程度、S/N(7/13-7/14)は▲0.085~▲0.080%程度での出合い。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、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>

現先レートT/Nは低水準で推移。閑散な地合いの中、店頭での買いからか3M物で▲0.105%、6M物で▲0.11%の散発的な出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、償還総額400億円程度に対して、発行総額は800億円程度と若干の発行超。一部の卸売業態で大型案件は見られたものの、案件数は少なくやや閑散なマーケットとなった。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

2017/7/11	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.087	0.090	0.000	20,195.48	114.50	114.06-07	114.31-32
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.041				-	▲ 0.092						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.090						
3W			0.000				-	▲ 0.091						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.094	▲ 0.100						
6M							▲ 0.105	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.151						
									日付	7/4	7/5	7/6	7/7	7/10
									日銀当預残	3,613,300	3,625,500	3,603,500	3,625,900	3,593,400
									準備預金残	3,226,300	3,237,700	3,208,200	3,244,400	3,204,200
									マネタリーベース	4,663,700	4,675,800	4,654,200	4,676,900	4,643,500
									無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.054%	▲0.051%	▲0.050%	▲0.050%
									コール市場残高	83,830	87,199	87,752	95,191	91,161
									うち無担	63,694	65,629	66,871	74,275	71,104
									うちO/N	38,539	40,189	40,866	48,070	45,824
									うち有担	20,136	21,570	20,881	20,916	20,057

●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)
5年利付国債	132	0.10%	22,000	2017/7/13	2022/6/20	87,406.0	18,025.0	100.6600	▲0.0330%	81.8127%	100.6700	▲0.0350%	3,967.0
エネルギー対策	-	-	7,000	2017/7/20	2018/7/20	77,610.0	6,999.94		0.0000%	9.1271%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	24,095	2017/7/11	2017/7/12		1,668	1,668		▲0.600	▲1.082	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,470	2017/7/11	2017/7/12		68	68		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/7/13	2017/7/20	1.65	1	1				

●2017年7月12日の予定

*5月の第3次産業活動指数
*6月の企業物価指数

*米国ページブック

◆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