

Central Daily Market Report

2017年7月13日(木)

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13日 | | 2017年7月14日 | | 2017年7月18日 | |
|-----------------------|------------|--------|------------|--------|-----------------|-----------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 800 | | ▲ 800 | | | 1,000 |
| 財政 | ▲ 24,600 | | 4,200 | | | ▲ 31,000 |
| 資金過不足 | ▲ 25,400 | | 3,400 | | | ▲ 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 | ▲ 1,600 |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | | | 11,200 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 400 | | ▲ 400 | 3,500 | |
| 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 | 100 | | 100 | | | |
| 国債補充供給 | ▲ 800 | 1,100 | | 800 | | |
| 当預増減 | ▲ 25,400 | | 15,000 | | | ▲ 26,500 |
| 当座預金残高 | 3,577,000 | | 3,592,000 | | | 3,565,500 |
| 準備預金残高 | 3,209,300 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,209,100 | | | | 7月14日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,209,000 | | | | 積数 | 200 |
| 非準備預金先 | 367,700 | | | | 1日平均 | 100 |
| 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 | 99.99% | 日数 | 93.33% | | |

●2017年7月13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1兆7,000億円減の320兆7,000億円(当座預金残高見込みは357兆8,000億円)。本日の無担O/N物は▲0.040%で寄り付き後、邦銀、証券業態の調達で▲0.045~▲0.030%の出会いとなった。積み最終日を控え、手堅く資金調達を行う先が散見され、レート水準を切り上げて推移した。出会い一巡後も▲0.03%近辺でビッドが残るなど堅調な展開となった。ターム物に関しては、ショートタームで引き合いが見られた。固定金利共通担保資金供給オペは2W物が8,000億円オファーされた。結果は1,591億円の応募札(期落ち分1,590億円)で未達となった。

<レポ市場>

GC T/N(7/14-7/18)は▲0.065~▲0.055%程度、S/N(7/18-7/19)は▲0.080~▲0.070%程度での出会い。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。3M物の入札は、W取引で▲0.105%から▲0.113%まで買い進まれる中、平均落札利回▲0.1082%・按分落札利回▲0.1033%と、しっかりの結果となった。セカンダリー市場では、3M物で▲0.109~▲0.107%での出会いが見られた。

<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1,700億円強に対して、発行総額は1,500億円強と若干の償還超。一部の建設・卸売業態で大型案件が見られたものの、落ち着いたマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

| 2017/7/13 | 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 | ▲ 0.065 | 0.001 | ▲ 0.040 | | | | - | ▲ 0.082 | 0.075 | ▲ 0.010 | 20,099.81 | 1.43 | 113.32-33 | 113.12-13 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.060 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.040 | ▲ 0.033 | ▲ 0.038 | | | | - | ▲ 0.088 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.045 | 0.000 | ▲ 0.029 | | | | - | ▲ 0.089 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.090 | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.042 | | | | - | ▲ 0.091 | | | | | | |
| 3M | | | 0.050 | | | | ▲ 0.108 | ▲ 0.100 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.106 | ▲ 0.121 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.094 | ▲ 0.151 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 7/6 | 7/7 | 7/10 | 7/11 | 7/12 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,603,500 | 3,625,900 | 3,593,400 | 3,612,000 | 3,602,400 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,208,200 | 3,244,400 | 3,204,200 | 3,221,600 | 3,220,700 |
| | | | | | | | | | マナタリーベース | 4,654,200 | 4,676,900 | 4,643,500 | 4,661,800 | 4,652,100 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.051% | ▲0.050% | ▲0.050% | ▲0.048% | ▲0.044% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 87,752 | 95,191 | 91,161 | 90,423 | 84,961 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 66,871 | 74,275 | 71,104 | 70,905 | 65,579 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 40,866 | 48,070 | 45,824 | 45,355 | 39,809 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 20,881 | 20,916 | 20,057 | 19,518 | 19,382 |

●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) |
|---------|-----|-------|--------|-----------|------------|-----------|-----------|----------|-------------|----------|----------|-------------|---------------|
| 国庫短期証券 | 695 | - | 43,800 | 2017/7/18 | 2017/10/16 | 161,087.0 | 35,594.4 | 100.0255 | ▲0.1033% | 62.6760% | 100.0267 | ▲0.1082% | 8,205.0 |
| 20年利付国債 | 161 | 0.60% | 10,000 | 2017/7/18 | 2037/6/20 | 34,042.0 | 8,126.0 | 99.8000 | 0.6110% | 34.8784% | 99.8800 | 0.6060% | 1,863.0 |
| 交付税特会 | - | - | 10,500 | 2017/7/24 | 2018/1/24 | 152,717.0 | 10,500.07 | | 0.0000% | 6.9233% | | 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 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞ | 8,000 | 2017/7/18 | 2017/7/31 | | 1,591 | 1,591 | | | | |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 18,002 | 2017/7/13 | 2017/7/14 | | 790 | 790 | | ▲0.500 | ▲0.597 | |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 10,000 | 2017/7/13 | 2017/7/14 | | 7 | 7 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |

| 種類 | スタート日 | エンド日 | 貸付利率 | 貸付予定総額(億円) |
|---------------|-------|-----------|-----------|------------|
| 被災地金融支援オペ | 第75回 | 2017/7/21 | 2018/7/20 | 0 |
| 被災地金融支援オペ(熊本) | 第14回 | 2017/7/21 | 2018/7/20 | 0 |

●2017年7月14日の予定

| | | |
|---------------|--|--|
| *5月の石油等消費動態統計 | *米国5月の企業在庫 *米国6月の消費者物価指数 *米国6月の小売売上高 | *米国6月の鉱工業生産・設備稼働率 *米国7月のミシガン大学、消費者信頼感指数速報 |
|---------------|--|--|

◆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お客様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