

Central Daily Market Report

2017年7月28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7月28日		2017年7月31日		2017年8月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		300		1,000	
財政	▲ 300		31,100		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 1,500		31,400		▲ 7,000	
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	4,200				10,800	
CP等買入		▲ 500	3,500	▲ 1,500		
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		▲ 100		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減		2,100		33,300		8,800
当座預金残高		3,596,400		3,629,700		3,638,500
準備預金残高		3,191,600				
積み終了先		3,191,100				
超過準備		3,191,100			7月31日以降の残り所要積立額 積数	7,800
非準備預金先		404,800			1日平均	500
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	99.74%	日数	48.39%	

●2017年7月28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2,000億円減少の318兆4,000億円(当座預金残高見込みは359兆8,000億円)。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。週末要因による取り上げの動きなどはあまり見られず、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(7/31-8/1)は▲0.085~▲0.075%程度、S/N(8/1-8/2)は▲0.085~▲0.08%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、短国買入オペが事前予想通りの5,000億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差+0.000%と市場実勢を反映した結果となった。セカンダリー市場は、オペ後に3Mで▲0.133%の出会いが見られた。

<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、償還は無かったものの、商社、石油、ノンバンク業態等から大型の発行が見られたため、発行額は2,300億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2017/7/28	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	▲ 0.063				-	▲ 0.087	0.070	0.005	19,959.84	▲ 119.80	111.09-10	111.10-12
T/N							-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.041				-	▲ 0.089						
2W			▲ 0.050				-	▲ 0.091						
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.096						
1M			0.001				-	▲ 0.101						
3M			0.050				▲ 0.130	▲ 0.110						
6M							▲ 0.120	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.121	▲ 0.150						
									日付	7/21	7/24	7/25	7/26	7/27
									日銀当預残	3,574,700	3,573,300	3,589,600	3,601,200	3,594,300
									準備預金残	3,167,600	3,170,400	3,179,300	3,190,600	3,181,900
									マネタリーベース	4,625,300	4,624,100	4,640,700	4,653,100	4,647,700
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.058%	▲0.060%	▲0.060%	▲0.063%
									コール市場残高	86,234	85,968	88,179	87,925	87,947
									うち無担	65,620	65,428	67,724	67,168	67,116
									うちO/N	39,870	39,368	41,619	40,833	41,366
									うち有担	20,614	20,540	20,455	20,757	20,831

●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
国庫短期証券買入	5,000	2017/8/1			11,495	5,000	0.000		0.002	88.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/8/1			12,404	2,802	0.001		0.002	15.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/8/1			12,421	3,308	0.003		0.003	57.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,700	2017/8/1			17,354	4,707	0.006		0.007	29.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,000	2017/7/28	2017/7/31		2	2		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	6,262	2017/7/28	2017/7/31		55	55		▲0.600	▲0.600	

●2017年7月31日の予定

*6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 (市場予想：前月比+1.7%)	*米国7月のシカゴPM景況感指数
*6月の住宅着工統計	*ユーロ圏7月の消費者物価指数速報値

◆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