

●資金需給

単位：億円	2017年8月2日 需給速報	2017年8月3日 需給予想	2017年8月4日 当社予想
銀行券	300	▲ 500	0
財政	▲ 63,500	▲ 16,800	3,000
資金過不足	▲ 63,200	▲ 17,300	3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	3,400		10,800
CP等買入		▲ 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			
E T F 買入			
国債補完供給		400	
当預増減	▲ 59,400	▲ 17,500	13,800
当座預金残高	3,581,600	3,564,100	3,577,900
準備預金残高	3,176,000		
積み終了先	3,175,600	8月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,175,600	積数	6,100
非準備預金先	405,600	1日平均	500
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	99.80%	日数 58.06%

●2017年8月2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5兆3,000億円減少の317兆8,000億円(当座預金残高見込みは358兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.086%、地銀業態から▲0.08~▲0.045%、信託・証券業態などから▲0.08~▲0.06%近辺の調達希望で始まり、朝方は▲0.075~▲0.045%のレンジでの出会い。一巡後も同水準で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件中心の取引が散見された。

＜レポ市場＞
GC T/N(8/3-8/4)は▲0.09~▲0.085%程度、S/N(8/4-8/7)は▲0.095~▲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入札を控えて様子見姿勢が強い中、3M物で▲0.123~▲0.121%の出会いが見られた程度だった。

＜CP市場＞
現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は5日にかかる発行であったものの、案件、金額共に少なく閑散だった。

●短期金融市場関連指標

2017/8/2	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.084	0.070	0.000	20,080.04	94.25	110.43-44	110.79-80
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.045	0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.097						
1M							-	▲ 0.101						
3M								▲ 0.125	▲ 0.110					
6M								▲ 0.120	▲ 0.123					
1Y								▲ 0.118	▲ 0.150					
									日付	7/26	7/27	7/28	7/31	8/1
									日銀当預残	3,601,200	3,594,300	3,596,400	3,629,300	3,641,000
									準備預金残	3,190,600	3,181,900	3,191,600	3,222,500	3,238,200
									マネタリーベース	4,653,100	4,647,700	4,650,900	4,683,500	4,695,300
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.064%	▲0.063%
									コール市場残高	87,925	87,947	92,223	88,728	90,933
									うち無担	67,168	67,116	70,840	64,245	69,656
									うちO/N	40,833	41,366	45,710	42,685	46,696
									うち有担	20,757	20,831	21,383	24,483	21,277

●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1年超3年以下)	2,800	2017/8/4			11,879	2,805	▲0.006		▲0.005	55.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/8/4			12,916	3,305	▲0.002		0.000	7.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,700	2017/8/4			17,916	4,707	▲0.001		0.000	61.2

●2017年8月3日の予定

*8月の日銀当座預金増減要因見込み	*英中銀MPC結果発表 *米国6月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国7月のISM非製造業景況指数	*国庫短期証券(699回)入札 (3ヶ月、44,000億円、8/7発行) *10年物価連動国債入札 (4,000億円、8/7発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、8/14借入)
-------------------	---	---

◆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。
◆本資料は何ら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論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