

Central Daily Market Report

2017年8月3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8月3日		2017年8月4日		2017年8月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 400		1,000	
財政	▲ 16,800		2,800		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 17,200		2,400		▲ 5,000	
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					1,300	▲ 1,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,900			
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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			700			
国債補完供給						
当預増減	▲ 17,400		13,700		▲ 5,000	
当座預金残高	3,564,200		3,577,900		3,572,900	
準備預金残高	3,180,000					
積み終了先	3,179,600					
超過準備	3,179,600				8月4日以降の残り所要積立額 積数 5,800	
非準備預金先	384,200				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	99.81%	日数	61.29%		

●2017年8月3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6兆1,000億円減少の311兆7,000億円(当座預金残高見込みは356兆4,000億円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.086~▲0.065%、地銀業態から▲0.075~▲0.04%、信託・証券業態などから▲0.08~▲0.06%近辺の調達希望で始まった。昨日よりもやや底堅く、朝方は▲0.075~▲0.04%のレンジで出会い、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、ショートターム物の出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(8/4-8/7)は▲0.09~▲0.085%程度、S/N(8/7-8/8)は▲0.085~▲0.075%程度での出会いとなった。S/Nは短国発行の影響もあり、売りが厚い印象であった。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3ヵ月物の入札が実施された。WI取引において▲0.120%の出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1178%、按分落札利回▲0.1142%と概ね事前予想通りの結果になった。セカンドリーは▲0.115~▲0.112%と小甘い出会いとなった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は建設、鉄鋼、石油業態からまった発行が見られ、総額1,400億円程度に達した。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

2017/8/3	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.084	0.065	▲ 0.005	20,029.26	▲ 50.78	110.75-76	110.63-65
T/N	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.019				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.015	▲ 0.037				-	▲ 0.091						
2W			0.000				-	▲ 0.093						
3W			▲ 0.035				-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.114	▲ 0.110						
6M							▲ 0.113	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.112	▲ 0.150						
									日付	7/27	7/28	7/31	8/1	8/2
									日銀当預残	3,594,300	3,596,400	3,629,300	3,641,000	3,581,600
									準備預金残	3,181,900	3,191,600	3,222,500	3,238,200	3,176,000
									マネタリーベース	4,647,700	4,650,900	4,683,500	4,695,300	4,635,700
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.063%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.063%
									コール市場残高	87,947	92,223	88,728	90,933	91,264
									うち無担	67,116	70,840	64,245	69,656	69,946
									うちO/N	41,366	45,710	42,685	46,696	46,086
									うち有担	20,831	21,383	24,483	21,277	21,318

●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	699	-	44,400	2017/8/7	2017/11/6	146,355.0	36,386.3	100.0285	▲0.1142%	82.2605%	100.0294	▲0.1178%	8,013.0
物価連動10年	22	0.10%	4,000	2017/8/7	2027/3/10	12,748.0	3,994.0	104.5500	▲0.3580%	69.4877%			
交付税特会	-	-	10,500	2017/8/14	2018/2/14	135,527.0	10,500.02		0.0000%	7.8082%		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	申込総額(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	2017/8/7	2017/8/21		1310	1310				

●2017年8月4日の予定

*6月の毎月勤労統計調査速報	*米国6月の貿易収支
	*米国7月の雇用統計

◆本資料は信頼できるとさ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