

Central Daily Market Report

2017年8月4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8月4日		2017年8月7日		2017年8月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		600		1,000	
財政	1,300		▲ 8,700		0	
資金過不足	1,000		▲ 8,100		1,000	
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					5,000	
国債買入	10,900				9,100	
CP等買入		▲ 300		▲ 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	700		500			
国債補完供給	▲ 100		100			
当預増減	12,200		▲ 8,100		15,100	
当座預金残高	3,576,400		3,568,300		3,583,400	
準備預金残高	3,191,400					
積み終了先	3,190,900				8月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,190,900				積数	4,200
非準備預金先	385,000				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	99.86%	日数	70.97%		

●2017年8月4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7兆8,000億円増加の319兆5,000億円(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、大手行から▲0.086%、地銀業態から▲0.075~▲0.04%、信託・証券業態などから▲0.08~▲0.055%近辺の調達希望で始まった。朝方は▲0.065~▲0.04%のレンジで出会い。週末要因もあって堅調な地合いが続き、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(8/7-8/8)は▲0.08~▲0.075%程度、S/N(8/8-8/9)は▲0.085~▲0.08%程度での出会いとなった。S/N(8-9)は日銀による利国、短国の買入オペで業者の売りは減少しているが、投資家の資金調達が継続して入っている。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短国買入オペが5,000億円実施された。応札額が1兆4,250億円と前回(オファー額5,000億円、応札額1兆1,495億円)、平均利回較差+0.001%、按分利回較差±0.000%と落ち着いた結果になった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は住宅業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は400億円程度にとどまった。発行レートは横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/8/4	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	▲ 0.054				-	▲ 0.083	0.060	▲ 0.005	19,952.33	▲ 76.93	109.88-90	110.08-09
T/N							-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.036				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.023				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.112	▲ 0.109						
6M							▲ 0.111	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.111	▲ 0.150						
									日付	7/28	7/31	8/1	8/2	8/3
									日銀当預残	3,596,400	3,629,300	3,641,000	3,581,600	3,564,200
									準備預金残	3,191,600	3,222,500	3,238,200	3,176,000	3,180,000
									マネタリーベース	4,650,900	4,683,500	4,695,300	4,635,700	4,618,700
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.057%
									コール市場残高	92,223	88,728	90,933	91,264	86,176
									うち無担	70,840	64,245	69,656	69,946	63,560
									うちO/N	45,710	42,685	46,696	46,086	40,280
									うち有担	21,383	24,483	21,277	21,318	22,616

●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	2017/8/8			14,250	5,003	0.000		0.001	40.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/8/8			10,790	2,801	0.001		0.002	25.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/8/8			14,333	3,304	0.002		0.003	38.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/8/8			8,221	2,002	0.000		0.003	29.2
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/8/8			4,321	1,003	▲0.002		0.001	34.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	29,846	2017/8/4	2017/8/7		105	105		▲0.600	▲0.600	

●2017年8月7日の予定

*6月の景気動向指数速報	*米国6月の消費者信用残高
*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国7月のFRB労働市場情勢指数

◆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