

Central Daily Market Report

2017年8月7日(月)

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7日 需給速報	2017年8月8日 需給予想	2017年8月9日 当社予想
銀行券	600	▲ 300	0
財政	▲ 10,600	1,100	▲ 6,000
資金過不足	▲ 10,000	800	▲ 6,000
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		9,200	
CP等買入		▲ 500	▲ 100
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	500	500	
国債補完供給		100	
当預増減	▲ 10,000	15,400	▲ 6,000
当座預金残高	3,566,400	3,581,800	3,575,800
準備預金残高	3,193,600		
積み終了先	3,193,100		
超過準備	3,193,100	8月8日以降の残り所要積立額 積数 3,600	
非準備預金先	372,800	1日平均 400	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額			3,008,500
準備預金進捗率	実績	99.88%	日数 74.19%

●2017年8月7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5,000億円減少の319兆円(当座預金残高見込みは356兆8,000億円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.086~▲0.08%、地銀業態から▲0.065~▲0.035%、信託・証券業態などから▲0.07~▲0.055%近辺の調達希望で始まった。先週末よりもやや強含み、朝方は▲0.065~▲0.035%のレンジで出合い。一巡後は▲0.07~▲0.03%の出合い水準で推移し、本日の取引を終えた。ターム物は出合い閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/8-8/9)は▲0.075~▲0.070%程度、S/N(8/9-8/10)は▲0.080~▲0.075%程度での出合いとなった。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T/Nは低位横ばいで推移。セカンダリー市場は、8日に予定されている6M物の入札を控えて様子見閑散。3M物で▲0.110%の出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先S/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、案件数は乏しかったものの、鉄鋼・機械・ノンバンク業態から大型の発行が見られ、発行総額は1,300億円程度まで膨らんだ。発行レートは0%近辺での落ち着いた取引となった。

●短期金融市場関連指標

2017/8/7	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.049				-	▲ 0.082	0.065	0.005	20,055.89	103.56	110.80-82	110.78-79
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.031				-	▲ 0.089						
2W							-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.111	▲ 0.109						
6M							▲ 0.110	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.150						
									日付	7/31	8/1	8/2	8/3	8/4
									日銀当預残	3,629,300	3,641,000	3,581,600	3,564,200	3,576,400
									準備預金残	3,222,500	3,238,200	3,176,000	3,180,000	3,191,400
									マネタリーベース	4,683,500	4,695,300	4,635,700	4,618,700	4,631,200
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.057%	▲0.054%
									コール市場残高	88,728	90,933	91,264	86,176	90,518
									うち無担	64,245	69,656	69,946	63,560	68,516
									うちO/N	42,685	46,696	46,086	40,280	46,181
									うち有担	24,483	21,277	21,318	22,616	22,002

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	29,840	2017/8/7	2017/8/8		29	29		▲0.600	▲0.600	

●2017年8月8日の予定

*6月の国際収支	*国庫短期証券(700回)入札 (6ヶ月、26,000億円、8/10発行)	*エネルギー対策借入 (7,000億円、8/21借入)
*6月の特定サービス産業動態統計速報	*30年利付国債入札 (8,000億円、8/10発行)	
*7月の景気ウォッチャー調査		

◆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