

# Central Daily Market Report

2017年8月9日(水)

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9日		2017年8月10日		2017年8月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 1,200		1,000	
財政	▲ 5,000		▲ 2,500		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 5,400		▲ 3,700		▲ 4,000	
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					1,500	▲ 1,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入					7,700	
CP等買入		▲ 200		▲ 900	3,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入	400		100			
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	▲ 5,200		▲ 4,200		6,700	
当座預金残高	3,576,600		3,572,400		3,579,100	
準備預金残高	3,189,100					
積み終了先	3,188,700				8月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,188,700				積数	2,800
非準備預金先	387,500				1日平均	500
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	99.91%	日数	80.65%		

## ●2017年8月9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1兆7,000億円減少の319兆2,000億円(当座預金残高見込みは357兆7,000億円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.086~▲0.04%、地銀業態から▲0.05~▲0.02%、信託・証券業態などから▲0.05~▲0.03%近辺の調達希望で始まった。昨日よりもさらに強い展開となり、朝方は▲0.035~▲0.02%のレンジで出合い。一巡後は▲0.06~▲0.03%近辺での出合いが見られた。ターム物の出合いはロール案件中心の取引であった。

### <レポ市場>

GC T/N(8/10-8/14)は▲0.070%程度、S/N(8/14-8/15)は▲0.070~▲0.065%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、20Y154~161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。3M物の入札が実施され、WI取引で▲0.112~▲0.110%での出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1110%・按分落札利回▲0.1082%と、概ね予想通りの結果となった。その他、6M物は▲0.120~▲0.115%での出合いが見られた。

### <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・石油・商社業態から大型の発行が見られ、償還総額500億円程度に対し発行総額は1,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは横ばい圏で、落ち着いた取引となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/8/9	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.080	0.055	▲ 0.010	19,738.71	▲ 257.30	110.10-12	109.82-83
T/N	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.005	▲ 0.022				-	▲ 0.086						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.001	0.010	0.000				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.111	▲ 0.108						
6M							▲ 0.119	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.150						
									日付	8/2	8/3	8/4	8/7	8/8
									日銀当預残	3,581,600	3,564,200	3,576,400	3,566,400	3,581,800
									準備預金残	3,176,000	3,180,000	3,191,400	3,193,600	3,205,000
									マネタリーベース	4,635,700	4,618,700	4,631,200	4,620,600	4,636,300
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.057%	▲0.054%	▲0.049%	▲0.042%
									コール市場残高	91,264	86,176	90,518	86,104	85,833
									うち無担	69,946	63,560	68,516	63,405	64,935
									うちO/N	46,086	40,280	46,181	42,690	42,854
									うち有担	21,318	22,616	22,002	22,699	20,898

## ●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	701	-	43,500	2017/8/14	2017/11/13	178,647.0	35,251.70	100.0270	▲0.1082%	24.2019%	100.0277	▲0.1110%	8,248.0

## ●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	2017/8/14	2017/8/28		1,530	1,530				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,700	2017/8/14			16,429	4,707	▲0.007		▲0.005	68.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/8/14			6,581	2,006	▲0.010		▲0.008	94.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/8/14			3,367	1,005	▲0.008		▲0.005	57.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	33,333	2017/8/9	2017/8/10		321	321		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年8月10日の予定

*6月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+3.7%)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、8/23借入)
*6月の第3次産業活動指数	*7月の企業物価指数
*米国7月の財政収支	*米国7月の生産者物価指数

◆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