

# Central Daily Market Report

2017年8月14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14日		2017年8月15日		2017年8月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		500		0	
財政	▲ 6,800		51,200		1,000	
資金過不足	▲ 6,100		51,700		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	1,500	▲ 1,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入	8,100		7,400			
CP等買入	3,000	▲ 400		▲ 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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300			300		
当預増減	4,300		66,400		1,000	
当座預金残高	3,576,300		3,642,700		3,643,700	
準備預金残高	3,199,400					
積み終了先	3,199,100					
超過準備	3,199,000					
非準備預金先	376,900					
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	100.00%	日数	96.77%		

## ●2017年8月14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、前日比横ばいの320兆5,000億円(当座預金残高見込みは357兆6,000億円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.086~▲0.08%、地銀業態から▲0.035~▲0.02%、信託・証券業態などから▲0.04~▲0.03%近辺の調達希望で始まった。積みの最終日を明日に控え、最後の調整ということもあり、先週末同様に調達意欲は強く、朝方は▲0.035~▲0.02%のレンジで出合い。一巡後は▲0.07~▲0.04%近辺での出合い水準で推移した。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(8/15-8/16)は▲0.07~▲0.045%、S/N(8/16-8/17)は▲0.095~▲0.07%程度の出合いだった。T/Nは積み最終日にあたって調整の売りが目立ち、徐々にレートが上昇した。新積み期間にかかるS/Nは運用サイドがしっかりとおり、前日からレートが低下した。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、10Y336、337、340、346などにビッドの出入りが目立った。

### <短国市場>

現先S/N物は引き続き低位で推移した。品薄感からか、3M▲0.125~▲0.120%、6M▲0.123%と強めの出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。夏季休暇の影響もあり、発行案件は1件のみと閑散であった。発行総額は100億円弱にとどまった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/8/14	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.075	0.050	▲ 0.005	19,537.10	▲ 192.64	109.25-26	109.74-75
T/N							-	▲ 0.057						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.035				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.035				-	▲ 0.091						
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.045	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.121	▲ 0.109						
6M							▲ 0.124	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.148						
									日付	8/4	8/7	8/8	8/9	8/10
									日銀当預残	3,576,400	3,566,400	3,581,800	3,576,600	3,572,000
									準備預金残	3,191,400	3,193,600	3,205,000	3,189,100	3,204,900
									マネタリーベース	4,631,200	4,620,600	4,636,300	4,631,600	4,628,200
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.049%	▲0.042%	▲0.033%	▲0.028%
									コール市場残高	90,518	86,104	85,833	88,159	87,467
									うち無担	68,516	63,405	64,935	67,746	67,567
									うちO/N	46,181	42,690	42,854	44,835	44,056
									うち有担	22,002	22,699	20,898	20,413	19,900

## ●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)	44,834	2017/8/14	2017/8/15		243	243		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年8月15日の予定

\*米国6月の企業在庫  
\*米国7月の小売売上高  
\*英国7月の消費者物価指数

◆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