

# Central Daily Market Report

2017年8月15日(火)

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15日		2017年8月16日		2017年8月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		0		▲ 1,000	
財政	51,300		▲ 1,000			0
資金過不足	51,900		▲ 1,000		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	7,500					
国債買入	7,400					
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						
E T F 買入			700			
国債補完供給	▲ 1,300	300		1,300		
当預増減	65,300		900		▲ 1,000	
当座預金残高	3,641,600		3,642,500		3,641,500	
準備預金残高	3,244,600					
積み終了先	3,244,600					
超過準備	3,244,600					
非準備預金先	397,000					
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					2,997,900	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2017年8月15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4兆8,000億円増額の325兆3,000億円(当座預金残高見込みは364兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.065~▲0.035%、地銀業態から▲0.03~▲0.015%、信託・証券業態などから▲0.04~▲0.025%近辺の調達希望で始まった。積み最終日による資金調達側の調整の動きから、一部で取り上がりも見られ、立ち上がりは▲0.035~▲0.015%のレンジで出合い。一巡後は調整程度の調達が散見される中▲0.04%近辺での出合い水準で推移し、今積み期の取引を終了した。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(8/16-8/17)は▲0.10~▲0.085%、S/N(8/17-8/18)は▲0.10~▲0.09%程度の出合いだった。T/N、S/Nともに調達サイドが薄く、徐々にレートを下げる展開となった。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、10Y336、337、340、341、346などにビッドの出入りが目立った。

### <短国市場>

現先S/N物は引続き低位で推移した。品薄感が漂う中、3M▲0.130~▲0.129%、1Y▲0.125%と強めの出合いが見られるなど、堅調なマーケットとなった。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。夏季休暇中ということもあり、償還総額ゼロに対し、発行総額も300億円弱と閑散な地合いが続いた。発行レートは低位横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/8/15	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.065	0.045	▲ 0.005	19,753.31	216.21	109.93-94	110.33-35
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.030				-	▲ 0.094						
2W	▲ 0.050	▲ 0.038	▲ 0.043				-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.099						
1M							-	▲ 0.102						
3M			0.000				▲ 0.125	▲ 0.110						
6M							▲ 0.124	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.147						
									日付	8/7	8/8	8/9	8/10	8/14
									日銀当預残	3,566,400	3,581,800	3,576,600	3,572,000	3,576,300
									準備預金残	3,193,600	3,205,000	3,189,100	3,204,900	3,199,300
									マネタリーベース	4,620,600	4,636,300	4,631,600	4,628,200	4,631,900
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.042%	▲0.033%	▲0.028%	▲0.028%
									コール市場残高	86,104	85,833	88,159	87,467	82,830
									うち無担	63,405	64,935	67,746	67,567	63,375
									うちO/N	42,690	42,854	44,835	44,056	40,824
									うち有担	22,699	20,898	20,413	19,900	19,455

## ●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)	30,000	2017/8/15	2017/8/16		1,306	1,306		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/8/17	2017/8/24	1.66	1	1				

## ●2017年8月16日の予定

*米国7月の住宅着工件数	*国庫短期証券(702回)入札(1年、23,000億円、8/21発行)	*国有林野借入(951億円、8/25借入)
*ユーロ圏4-6月期のGDP2次速報		

◆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