

Central Daily Market Report

2017年8月16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16日		2017年8月17日		2017年8月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 300	▲ 1,000			
財政	0	1,100	2,000			
資金過不足	100	800	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						
国債買入					7,400	
CP等買入		▲ 100	▲ 200			
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		800			
国債補完供給	▲ 1,300	1,300	1,300			
当預増減	700	2,700	8,400			
当座預金残高	3,642,300	3,645,000	3,653,400			
準備預金残高	3,236,000					
積み終了先	1,989,500			8月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	802,000			積数	563,900	
非準備預金先	406,300			1日平均	18,800	
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	81.19%	日数	3.23%		

●2017年8月16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3,000億円減少の325兆円(当座預金残高見込みは364兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは国内勢より▲0.06~▲0.04%の調達希望で始まった。積みの初日であることから全般的には慎重姿勢な中で、立ち上がりは▲0.06~▲0.04%の出会いとレート低下。一巡後は閑散とした中で本日の取引を終えた。ターム物は1W物の出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(8/17-8/18)は▲0.10~▲0.09%、S/N(8/18-8/21)は▲0.10~▲0.09%程度の出会いだった。前日に続いて調達サイドが薄く、レートは低位横ばい圏での取引だった。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、341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。本日は1Y物の入札が実施された。WI取引において、▲0.126%から▲0.135%へと買い進まれる中、平均落札利回▲0.1281%、按分落札利回▲0.1251%と、WI取引を反映した強めの結果になった。セカンダリーは▲0.128%で出合った。その他の出会いは3M物で▲0.135%、6M物で▲0.127%の水準でみられた。

<CP市場>

CP市場は、引続き夏季休暇の影響が見られたものの、五・十日発行ということもあり、石油・石炭業態で大口での発行が見られ、発行総額は850億円超まで膨らんだ。発行レートは、一部銘柄を除き、引続き0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/8/16	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	▲ 0.047				-	▲ 0.094	0.035	▲ 0.010	19,729.28	▲ 24.03	110.59-61	110.86-87
T/N							-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.038				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.050	0.010	▲ 0.030				-	▲ 0.098						
3W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.023				-	▲ 0.100						
1M			0.040				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.125	▲ 0.110						
6M							▲ 0.125	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.148						
									日付	8/8	8/9	8/10	8/14	8/15
									日銀当預残	3,581,800	3,576,600	3,572,000	3,576,300	3,641,600
									準備預金残	3,205,000	3,189,100	3,204,900	3,199,300	3,244,600
									マネタリーベース	4,636,300	4,631,600	4,628,200	4,631,900	4,696,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.042%	▲ 0.033%	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.026%
									コール市場残高	85,833	88,159	87,467	82,830	81,748
									うち無担	64,935	67,746	67,567	63,375	62,119
									うちO/N	42,854	44,835	44,056	40,824	41,198
									うち有担	20,898	20,413	19,900	19,455	19,629

●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	702	-	23,000	2017/8/21	2018/8/20	92,236.0	18,610.9	100.1250	▲0.1251%	17.8341%	100.1280	▲0.1281%	4,388.6
国有林野借入	-	-	951	2017/8/25	2022/8/25	3,404.0	951.00		0.0280%	7.3184%		0.0070%	

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,400	2017/8/18			12,752	4,407	▲0.002		0.000	69.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/8/18			6,709	2,003	0.010		0.010	99.0
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/8/18			3,534	1,006	0.012		0.013	6.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	35,451	2017/8/16	2017/8/17		1,318	1,318		▲0.500	▲0.500	

●2017年8月17日の予定

*7月の貿易統計	*米国7月の鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(703回)入札(3ヶ月、44,000億円、8/21発行)
	*ユーロ圏7月の消費者物価指数改定値	*5年利付国債入札(22,000億円、8/21発行)

◆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