

Central Daily Market Report

2017年8月18日(金)

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18日		2017年8月21日		2017年8月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		800			0
財政	▲ 1,100		▲ 48,200			1,000
資金過不足	▲ 1,400		▲ 47,400			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	▲ 1,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					7,500	
国債買入	7,500				10,500	
CP等買入		▲ 400		▲ 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						
国債補完供給	▲ 800	2,100		800		
当預増減		7,000		▲ 46,500		19,000
当座預金残高		3,649,900		3,603,400		3,622,400
準備預金残高		3,238,200				
積み終了先		3,230,900				
超過準備		3,196,500			8月21日以降の残り所要積立額 積数 27,100	
非準備預金先		411,700			1日平均 1,000	
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	99.10%	日数		16.13%

●2017年8月18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324兆円(当座預金残高見込みは365兆円)。朝方の無担O/Nは信託・地銀・証券より▲0.07~▲0.04%の調達希望で始まった。積み序盤の三日積みによる慎重姿勢から、立ち上がりは▲0.07~▲0.04%の出合い。一巡後もレートは低下基調で、▲0.08~▲0.07%近辺の出合いが散見され、本日の取引を終えた。ターム物は引き続き閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/21-8/22)は▲0.10~▲0.095%、S/N(8/22-8/23)は▲0.10~▲0.09%程度の出合いだった。短国買入オペ、輪番オペが通知されたものの、参加者の動きに特段の変化は見られず、レートは引き続き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、10Y336、341、343などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先T/N物は引き続き低位で推移した。本日は、短国買入オペが事前予想通りの7,500億円でオフアされた。平均利回較差▲0.002%、按分利回較差▲0.006%と堅調なマーケットを反映した結果となった。3M物で▲0.144~▲0.138%、1Y物で▲0.144~▲0.138%での出合いが見られ、共にオペ後に買い進まれる展開となった。

<CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。発行市場は、案件数は膨らまないものの、卸売業態で大口での調達が行われ、償還総額350億円程度に対し、発行総額は650億円弱と発行超となった。発行レートは、昨日のCPオペにおけるレートの大幅低下を受け、期越え物中心に強合む展開となった。

●短期金融市場関連指標

2017/8/18	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	
	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.098	0.035	▲ 0.005	19,470.41	▲ 232.22	109.32-34	109.05-06
T/N							-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.230	▲ 0.019				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.037				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.099						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.142	▲ 0.110						
6M							▲ 0.131	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.139	▲ 0.148						
									日付	8/10	8/14	8/15	8/16	8/17
									日銀当預残	3,572,000	3,576,300	3,641,600	3,642,300	3,642,900
									準備預金残	3,204,900	3,199,300	3,244,600	3,236,000	3,234,000
									マネタリーベース	4,628,200	4,631,900	4,696,500	4,697,100	4,698,000
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.028%	▲0.026%	▲0.047%	▲0.049%
									コール市場残高	87,467	82,830	81,748	91,322	87,206
									うち無担	67,567	63,375	62,119	69,919	66,364
									うちO/N	44,056	40,824	41,198	46,488	43,113
									うち有担	19,900	19,455	19,629	21,403	20,842

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/8/28	2018/2/28	133,576.0	10,500.02		0.0000%	7.9232%		0.0000%	

●オペ結果

種類	オファ額(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
国庫短期証券買入	7,500	2017/8/22			19,437	7,501	▲0.006		▲0.002	7.9
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/8/22			9,243	2,808	▲0.004		▲0.003	19.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/8/22			8,426	3,307	▲0.006		▲0.004	96.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,400	2017/8/22			13,650	4,407	▲0.003		▲0.002	39.2
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファ分))	39,834	2017/8/18	2017/8/21		814	814		▲0.500	▲0.500	

●2017年8月21日の予定

*特にありません。

◆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