

Central Daily Market Report

2017年8月22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22日		2017年8月23日		2017年8月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500	▲ 300	▲ 1,000			
財政	300	▲ 800	▲ 13,000			
資金過不足	800	▲ 1,100	▲ 14,000			
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	10,700					
CP等買入	3,000	▲ 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		500			
国債補完供給	▲ 100	200	100			
当預増減	22,700		▲ 700		▲ 14,000	
当座預金残高	3,626,600		3,625,900		3,611,900	
準備預金残高	3,211,600					
積み終了先	3,208,500					
超過準備	3,207,100					
非準備預金先	415,000					
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	99.46%	日数	22.58%		

●2017年8月22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1兆6,000億円増加の321兆円(当座預金残高見込みは362兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは信託・地銀・証券より▲0.08~▲0.045%基調で始まった。前日対比でレートは低下基調で、立ち上がりは▲0.075~▲0.045%の出会い。一巡後は▲0.08~▲0.075%の出会いが散見され、本日の取引を終えた。ターム物は1~2W物の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(8/23-8/24)は▲0.100~▲0.090%、S/N(8/24-8/25)は▲0.105~▲0.095%程度での出会い。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・131、10Y336~347などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライ市場は、出会いが見られず、閑散であった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は800億円弱の償還に対して、600億円強の発行が見られた。小型案件が中心であり、発行レートは横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2017/8/22	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.097	0.035	0.005	19,383.84	▲ 9.29	109.01-02	109.35-36
T/N							-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.036				-	▲ 0.101						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.101						
3W			0.000				-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.144	▲ 0.110						
6M							▲ 0.133	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.148						
									日付	8/15	8/16	8/17	8/18	8/21
									日銀当預残	3,641,600	3,642,300	3,642,900	3,649,900	3,603,900
									準備預金残	3,244,600	3,236,000	3,234,000	3,238,200	3,188,400
									マネタリーベース	4,696,500	4,697,100	4,698,000	4,705,300	4,658,400
									無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.047%	▲0.049%	▲0.052%	▲0.053%
									コール市場残高	81,748	91,322	87,206	90,973	87,041
									うち無担	62,119	69,919	66,364	70,806	66,267
									うちO/N	41,198	46,488	43,113	46,855	42,826
									うち有担	19,629	21,403	20,842	20,167	20,774

●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)
20年利付国債	161	0.60%	10,000	2017/8/24	2037/6/20	36,652.0	8,133.00	100.8500	0.5520%	63.1797%	100.8800	0.5500%	1,865.0

●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	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)	43,850	2017/8/22	2017/8/23		54	54		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/8/24	2017/8/31	1.66	1	1				

●2017年8月23日の予定

*米国7月の新築一戸建て販売件数

*交付税借入
(10,500億円、9/4借入)

◆本資料は信頼できるとさ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