

Central Daily Market Report

2017年8月23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23日		2017年8月24日		2017年8月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 800		▲ 11,800		1,000	
資金過不足	▲ 1,000		▲ 12,900		0	
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					9,100	
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					900	▲ 900
社債等買入						
E T F買入	500		200			
国債補充供給		100				
当預増減	▲ 600		▲ 13,100		9,100	
当座預金残高	3,626,000		3,612,900		3,622,000	
準備預金残高	3,201,300					
積み終了先	3,198,400					
超過準備	3,198,400				8月24日以降の残り所要積立額 積数 13,200	
非準備預金先	424,700				1日平均 600	
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	99.56%	日数	25.81%		

●2017年8月23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4,000億円増加の321兆4,000億円(当座預金残高見込みは362兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは信託・地銀・証券より▲0.08~▲0.045%のビッドで始まった。立ち上がりの出合いの中心は小幅上昇の▲0.07~▲0.04%となった。なお本日は一部業態より試し取りが行われ、まとまった出合いが見られた。ターム物は1W物の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(8/24-8/25)は▲0.100~▲0.090%、S/N(8/25-8/28)は▲0.100~▲0.095%程度での出合い。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。アウトライト市場は、3M物で▲0.14%の少額出合いが見られた程度で、総じて閑散であった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は、五・十日発行にあたり、1,000億円弱の償還に対して、3,000億円強の発行となった。ノンバンク・機械業態からは大型発行案件が実施された。発行レートは、引き続き期越物で堅調な水準での決着が見られた。

●短期金融市場関連指標

2017/8/23	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	▲ 0.080	0.030	▲ 0.040				-	▲ 0.097	0.030	▲ 0.005	19,434.64	50.80	109.73-74	109.42-44
T/N							-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.102						
1M			0.001				-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.142	▲ 0.110						
6M							▲ 0.132	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.139	▲ 0.148						
									日付	8/16	8/17	8/18	8/21	8/22
									日銀当預残	3,642,300	3,642,900	3,649,900	3,603,900	3,626,600
									準備預金残	3,236,000	3,234,000	3,238,200	3,188,400	3,211,600
									マネタリーベース	4,697,100	4,698,000	4,705,300	4,658,400	4,680,600
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.049%	▲0.052%	▲0.053%	▲0.055%
									コール市場残高	91,322	87,206	90,973	87,041	91,635
									うち無担	69,919	66,364	70,806	66,267	70,613
									うちO/N	46,488	43,113	46,855	42,826	47,028
									うち有担	21,403	20,842	20,167	20,774	21,022

●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	2017/9/4	2018/3/6	132,163.0	10,500.10		0.0000%	8.0124%		0.0000%	

●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1年超3年以下)	2,800	2017/8/25			7,590	2,807	0.002		0.003	69.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/8/25			8,165	3,303	0.002		0.003	98.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/8/25			6,217	2,009	0.007		0.009	79.4
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/8/25			2,993	1,004	0.002		0.005	19.0
社債等買入	1,000	2017/8/29			3,053	1,001	0.042		0.050	55.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/8/23	2017/8/24		33	33		▲0.600	▲0.600	

●2017年8月24日の予定

*6月の景気動向指数改訂状況	*米国7月の中古住宅販売 *英国4-6月期のGDP改定値	*国庫短期証券(704回)入札 (3ヶ月、44,000億円、8/28発行) *流動性供給入札 (5,500億円、8/28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