

Central Daily Market Report

2017年8月25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25日		2017年8月28日		2017年8月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		900			0
財政	1,900		▲ 3,800			1,000
資金過不足	1,300		▲ 2,900			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			1,900	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						2,500
国債買入	9,400					5,100
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
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		▲ 300				1,000
E T F 買入	800		1,000			
国債補完供給		100				
当預増減	10,900		▲ 1,800			9,600
当座預金残高	3,623,700		3,621,900			3,631,500
準備預金残高	3,212,300					
積み終了先	3,211,800					
超過準備	3,211,300				8月28日以降の残り所要積立額	7,200
非準備預金先	411,400				積数	400
					1日平均	400
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	99.76%	日数	38.71%		

●2017年8月25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1兆7,000億円増加の322兆億円(当座預金残高見込みは362兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは信託・地銀・証券より▲0.075~▲0.045%の調達希望で始まった。一部業態では取り上がりの動きも見られ、立ち上がりは▲0.075~▲0.035%の出会い。一巡後は閑散で、▲0.07%台の出会いが散見され、本日の取引を終えた。ターム物は1W物の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(8/28-8/29)は▲0.095~▲0.090%、S/N(8/29-8/30)は▲0.100~▲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。本日は短国買入オペアが、事前予想よりも少額の2,500億円でオファーされ、平均落札利回較差▲0.026%、按分落札利回較差▲0.034%の強めの決着となった。アウトライト市場は、3M物で▲0.20%で出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は1,800億円弱の償還に対して、300億円強の発行にとどまり閑散であった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2017/8/25	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	▲ 0.055				-	▲ 0.096	0.010	▲ 0.010	19,452.61	98.84	109.51-52	109.67-68
T/N							-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.037				-	▲ 0.106						
2W			0.000				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.175	▲ 0.112						
6M							▲ 0.145	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.154						
									日付	8/18	8/21	8/22	8/23	8/24
									日銀当預残	3,649,900	3,603,900	3,626,600	3,626,000	3,612,800
									準備預金残	3,238,200	3,188,400	3,211,600	3,201,300	3,208,000
									マネタリーベース	4,705,300	4,658,400	4,680,600	4,680,300	4,668,200
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.053%	▲0.055%	▲0.040%	▲0.052%
									コール市場残高	90,973	87,041	91,635	103,159	93,336
									うち無担	70,806	66,267	70,613	81,952	71,267
									うちO/N	46,855	42,826	47,028	57,687	46,122
									うち有担	20,167	20,774	21,022	21,207	22,069

●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	応募総額(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	2,500	2017/8/29			7,580	2,501	▲0.034		▲0.026	43.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/8/29			16,886	4,104	▲0.007		▲0.005	15.8
国債買入(変動利付債)	1,000	2017/8/29			2,868	1,002	▲0.260		▲0.290	16.7

●2017年8月28日の予定

*月例経済報告

*英国休日(Summer Bank Holiday)

◆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