

●資金需給

単位：億円	2017年8月28日		2017年8月29日		2017年8月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		0		▲ 1,000	
財政	▲ 3,500		▲ 3,800		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 2,800		▲ 3,800		▲ 2,000	
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		7,100	
国債買入			5,200			
CP等買入		▲ 300		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入			1,000			
E T F買入	1,000					
国債補完供給						
当預増減	▲ 1,700		4,400		5,100	
当座預金残高	3,622,000		3,626,400		3,631,500	
準備預金残高	3,220,600					
積み終了先	3,219,400					
超過準備	3,219,300					
非準備預金先	401,400					
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	99.80%	日数	41.94%		

●2017年8月28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1,000億円増加の322兆1,000億円(当座預金残高見込みは362兆2,000億円)。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。立ち上がりは先週末から横ばいの▲0.075~▲0.04%の出合い。一巡後は調達意欲が減退し、▲0.08~▲0.07%の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/29-8/30)は▲0.095~▲0.090%、S/N(8/30-8/31)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5Y130~132、10Y335~347などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移。動意なく閑散な地合いの中、3M物で▲0.18%の少額出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は2,000億円強と発行超。卸売業態において大型案件が見られたものの、案件数は膨らまず比較的落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。本日は、CP等買入オファーが3,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.026%・按分レート▲0.040%と、前回(平均▲0.014%・按分▲0.035%)比で低下する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/8/28	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.056				-	▲ 0.098	0.005	▲ 0.005	19,449.90	▲ 2.71	109.34-35	109.15-16	
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.098							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.039				-	▲ 0.105							
2W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.043				-	▲ 0.102							
3W							-	▲ 0.103							
1M							-	▲ 0.107							
3M							▲ 0.175	▲ 0.113							
6M							▲ 0.144	▲ 0.123							
1Y							▲ 0.149	▲ 0.152							
										日付	8/21	8/22	8/23	8/24	8/25
										日銀当預残	3,603,900	3,626,600	3,626,000	3,612,800	3,623,700
										準備預金残	3,188,400	3,211,600	3,201,300	3,208,000	3,212,300
										マネタリーベース	4,658,400	4,680,600	4,680,300	4,668,200	4,679,800
										無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.055%	▲0.040%	▲0.052%	▲0.055%
										コール市場残高	87,041	91,635	103,159	93,336	99,269
										うち無担	66,267	70,613	81,952	71,267	77,164
										うちO/N	42,826	47,028	57,687	46,122	50,869
										うち有担	20,774	21,022	21,207	22,069	22,105

●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年以下)	1,000	2017/8/30			3,544	1,001	0.001		0.004	70.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/8/30			11,717	2,803	0.003		0.005	58.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/8/30			12,047	3,300		0.008	0.008	
CP等買入	3,000	2017/8/31			5,509	3,000	▲0.040		▲0.026	87.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,065	2017/8/28	2017/8/29		45	45		▲0.600	▲0.600	

●2017年8月29日の予定

*7月の完全失業率(市場予想：2.8%)	*米国6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*7月の有効求人倍率(市場予想：1.52倍)	*米国8月のCB消費者信頼感指数
*7月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比+0.7%)	*流動性供給入札(4,000億円、8/31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