

# Central Daily Market Report

2017年8月29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29日		2017年8月30日		2017年8月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		200		▲ 700	
財政	▲ 900		400		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 1,100		600		▲ 4,700	
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	2,500					
国債買入	5,200		7,400			
CP等買入		▲ 500		▲ 100	3,000	
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						
国債補完供給						
当預増減	7,100		7,900		▲ 1,700	
当座預金残高	3,629,100		3,637,000		3,635,300	
準備預金残高	3,215,600					
積み終了先	3,214,100					
超過準備	3,214,100					
非準備預金先	413,500					
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					2,996,900	
準備預金進捗率	実績	99.85%	日数	45.16%		

## ●2017年8月29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5,000億円減少の321兆6,000億円(当座預金残高見込みは362兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、概ね前日同様の信託・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▲0.075~▲0.045%の出会い。一巡後は閑散としたなかで、▲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1~2Wの出会いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(8/30-8/31)は▲0.095~▲0.090%、S/N(8/31-9/1)は▲0.140~▲0.130%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5Y130~132、10Y334~347、SL158~161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。品薄感が強く閑散な地合いの中、期近物の散発的な出会いが見られた程度。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。月末発行の応当入札日より、あらゆる業態からの発行が実施され、大型案件が多数重なる大変活況なマーケットとなった。償還・発行額は共に概ね1兆円となった。発行レートは全般的に低位横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/8/29	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.097	0.000	▲ 0.005	19,362.55	▲ 87.35	108.73-74	108.50-51
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.041				-	▲ 0.106						
2W							-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.105						
1M			0.005				-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.175	▲ 0.115						
6M							▲ 0.144	▲ 0.125						
1Y							▲ 0.147	▲ 0.154						
									日付	8/22	8/23	8/24	8/25	8/28
									日銀当預残	3,626,600	3,626,000	3,612,800	3,623,700	3,622,000
									準備預金残	3,211,600	3,201,300	3,208,000	3,212,300	3,220,600
									マネタリーベース	4,680,600	4,680,300	4,668,200	4,679,800	4,677,400
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.040%	▲0.052%	▲0.055%	▲0.056%
									コール市場残高	91,635	103,159	93,336	99,269	96,076
									うち無担	70,613	81,952	71,267	77,164	73,642
									うちO/N	47,028	57,687	46,122	50,869	47,807
									うち有担	21,022	21,207	22,069	22,105	22,434

## ●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)
流動性供給	244	-	4,000	2017/8/31		9,675.0	3,982.00		▲0.0030%	79.9307%		▲0.0070%	

## ●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)	9,446	2017/8/29	2017/8/30		1	1		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/8/31	2017/9/8	1.65	0	0				

## ●2017年8月30日の予定

\*7月の商業動態統計速報

\*米国4-6月期のGDP改定値

\*交付税特別会計借入(10,500億円、9/7借入)

◆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