

# Central Daily Market Report

2017年8月30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30日 需給速報	2017年8月31日 需給予想	2017年9月1日 当社予想
銀行券	0	▲ 200	0
財政	300	▲ 1,500	▲ 8,000
資金過不足	300	▲ 1,700	▲ 8,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
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	7,400		7,400
CP等買入		▲ 100	3,000 ▲ 2,300
貸出支援基金(成)			4,000 ▲ 300
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
E T F 買入		700	
国債補完供給			
当預増減	7,600	▲ 300	3,100
当座預金残高	3,636,700	3,636,400	3,639,500
準備預金残高	3,225,500		
積み終了先	3,224,800		
超過準備	3,224,400		
非準備預金先	411,200		
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	99.89%	日数
			48.39%

## ●2017年8月30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322兆円(当座預金残高見込みは363兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは信託業態より▲0.075~▲0.07%、地銀・証券業態より▲0.08~▲0.045%近辺の調達希望で始まった。引き続き調達意欲は限定的で、立ち上がりは▲0.075~▲0.45%の前日比横ばい圏での出会い。一巡後も調達ニーズは弱く、▲0.07%台の出会いが散見され、本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/N(8/31-9/1)は▲0.105~▲0.100%、S/N(9/1-9/4)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5Y130~132、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、特段の出会いは見られていない。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は食料品・石油業態において大型案件が見られ、償還総額100億円程度に対して発行総額は1,000億円強と発行超。月初発行の応当入札日としては比較的活況なマーケットとなった。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

2017/8/30	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	▲ 0.059				-	▲ 0.098	0.000	0.000	19,506.54	143.99	109.77-78	110.01-02
T/N	▲ 0.030	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.045	0.010	▲ 0.034				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.174	▲ 0.117						
6M							▲ 0.145	▲ 0.125						
1Y							▲ 0.147	▲ 0.154						
									日付	8/23	8/24	8/25	8/28	8/29
									日銀当預残	3,626,000	3,612,800	3,623,700	3,622,000	3,629,100
									準備預金残	3,201,300	3,208,000	3,212,300	3,220,600	3,215,600
									マネタリーベース	4,680,300	4,668,200	4,679,800	4,677,400	4,684,600
									無担O/N加重平均	▲0.040%	▲0.052%	▲0.055%	▲0.056%	▲0.057%
									コール市場残高	103,159	93,336	99,269	96,076	95,974
									うち無担	81,952	71,267	77,164	73,642	73,153
									うちO/N	57,687	46,122	50,869	47,807	46,968
									うち有担	21,207	22,069	22,105	22,434	22,821

## ●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	棄分率	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	2017/9/7	2018/3/8	139,783.0	10,500.11		0.0000%	7.5721%		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5年超10年以下)	4,100	2017/9/1			11,397	4,103	0.007		0.011	13.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/9/1			4,717	2,008	0.011		0.013	69.3
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/9/1			2,437	1,002	0.011		0.014	18.3
国債買入(物価連動債)	250	2017/9/1			1,640	251	▲0.240		▲0.286	16.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	12,390	2017/8/30	2017/8/31		4	4		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	本則第29回	2017/9/1	0	4,000	51
成長基盤強化	ABL等特則第25期	2017/9/4	0	9	4
成長基盤強化	小口特則第22期	2017/9/1	0	7.03	9
成長基盤強化	米ドル特則第21期	2017/9/5		1,722	25
成長基盤強化	米ドル特則第17期(借り換え)	2017/9/5		3,963	29
成長基盤強化	米ドル特則第13期(借り換え)	2017/9/5		13	13
成長基盤強化	米ドル特則第9期(借り換え)	2017/9/5		1,356	29

## ●2017年8月31日の予定

*政井日銀審議委員、愛媛県金融経済懇話会にて講演	*米国7月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(705回)入札(3ヶ月、44,000億円、9/4発行)
*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲0.5%)	*米国8月のシカゴPM景況感指数	*2年利付国債入札(22,000億円、9/15発行)
*7月の住宅着工統計	*ユーロ圏8月の消費者物価指数速報値	

◆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