Central Daily Market Report

2017年8月31日（木）
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31日 需給速報		2017年9月1日 需給予想		2017年9月4日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 100		1,000	
財政	▲ 1,500		▲ 8,700		▲ 17,000	
資金過不足	▲ 1,700		▲ 8,800		▲ 16,000	
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					1,400	▲ 1,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,700			
CP等買入	3,000	▲ 2,300		▲ 200		
貸出支援基金(成)			4,000	▲ 4,000		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ＥＴＦ買入	700					
国債補完供給	▲ 300			300		
当預増減	▲ 600		▲ 1,100		▲ 16,100	

当座預金残高	3,636,100	3,635,000	3,618,900
準備預金残高	3,223,800		
積み終了先	3,223,300	9月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,223,300	積数	2,800
非準備預金先	412,300	1日平均	200
積み期間（8/16～9/15）の所要準備額			2,994,300
準備預金進捗率	実績 99.91%	日数	51.61%

●2017年8月31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322兆4,000億円(当座預金残高見込みは363兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは信託・証券業態より▲0.08～▲0.075%、地銀業態より▲0.08～▲0.05%近辺の調達希望で始まった。月末日により調達を控える動きも散見されたためレートは小幅低下し、出合いの中心は▲0.075～▲0.05%となった。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(9/1-9/4)は▲0.100～▲0.095%、S/N(9/4-9/5)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、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。3M物の入札が実施され、WI取引での▲0.16～▲0.163%での出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1760%・按分落札利回▲0.1683%と、予想以上に強めの結果となった。その後のセカンダリー市場では、6M物で▲0.19%、3M物においてはショートカバーからか▲0.45～▲0.16%まで買い進まれた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は案件少なく、発行・償還総額共に100億円程度と非常に閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/8/31	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.066				－	▲ 0.098
T/N	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.032				－	▲ 0.099
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.102
2W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.039				－	▲ 0.102
3W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.028				－	▲ 0.103
1M							－	▲ 0.125
3M							▲ 0.252	▲ 0.120
6M							▲ 0.150	▲ 0.127
1Y							▲ 0.152	▲ 0.154

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.000	0.000	19,646.24	139.70	110.46-48	110.48-50

日付	8/24	8/25	8/28	8/29	8/30
日銀当預残	3,612,800	3,623,700	3,622,000	3,629,100	3,636,700
準備預金残	3,208,000	3,212,300	3,220,600	3,215,600	3,224,400
マネタリーベース	4,668,200	4,679,800	4,677,400	4,684,600	4,692,300
無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.055%	▲0.056%	▲0.057%	▲0.059%
コール市場残高	93,336	99,269	96,076	95,974	90,137
うち無担	71,267	77,164	73,642	73,153	67,048
うちO/N	46,122	50,869	47,807	46,968	42,753
うち有担	22,069	22,105	22,434	22,821	23,089

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	705	－	43,900	2017/9/4	2017/12/4	156,827.0	35,841.7	100.0420	▲0.1683%	58.4646%	100.0439	▲0.1760%	8,058.0
2年利付国債	380	0.10%	22,000	2017/9/15	2019/9/15	88,430.0	17,810.00	100.4950	▲0.1460%	5.1418%	100.5010	▲0.1490%	4,181.0

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2017/9/4	2017/9/19		1,360	1,360				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	13,114	2017/8/31	2017/9/1		103	103		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	2,047	2017/8/31	2017/9/1		186	186		▲0.600	▲0.600	

●2017年9月1日の予定

*4-6月期の法人企業統計調査季報
*8月の消費動向調査
*米国7月の建設支出
*米国8月の雇用統計
*米国8月のISM製造業景況指数
*交付税特別会計借入
（10,500億円、9/11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。
◆本資料は何ら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論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