

Central Daily Market Report

2017年8月1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1日		2017年8月2日		2017年8月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		200		1,000	
財政	▲ 3,800		▲ 62,400		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 3,800		▲ 62,200		▲ 22,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入	10,900		3,400			
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	100		400		
当預増減	11,700		▲ 58,400		▲ 22,000	
当座預金残高	3,641,000		3,582,600		3,560,600	
準備預金残高	3,238,200					
積み終了先	3,237,600				8月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,237,600				積数 6,500	
非準備預金先	402,800				1日平均 500	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					2,996,200	
準備預金進捗率	実績	99.78%	日数	54.84%		

●2017年8月1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323兆1,000億円(当座預金残高見込みは364兆円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.086%、地銀業態から▲0.08~▲0.045%、信託・証券業態などから▲0.08~▲0.06%近辺の調達希望で始まった。朝方は昨日同様▲0.075~▲0.045%のレンジで出会い、一巡後も同水準で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(8/2-8/3)は▲0.09~▲0.085%程度、S/N(8/3-8/4)は▲0.095~▲0.085%程度での出会いとなった。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、20Y158~161、30Y55などにビッドの出入りが多く見られた。10Y347回債はリオープン発行となり、水準は甘くなったもののショートが残っている。

<短国市場>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライト市場は3M物で▲0.128%の出会いが見られた程度で、全般的に動意に乏しく閑散だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は案件、金額共に少なく閑散。

●短期金融市場関連指標

2017/8/1	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)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.083	0.070	▲ 0.003	19,985.79	60.61	110.36-37	110.20-21
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.050	▲ 0.015	▲ 0.036				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.097						
1M	▲ 0.014	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.130	▲ 0.109						
6M							▲ 0.120	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.121	▲ 0.150						
									日付	7/25	7/26	7/27	7/28	7/31
									日銀当預残	3,589,600	3,601,200	3,594,300	3,596,400	3,629,300
									準備預金残	3,179,300	3,190,600	3,181,900	3,191,600	3,222,500
									マネタリーベース	4,640,700	4,653,100	4,647,700	4,650,900	4,683,500
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.060%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.064%
									コール市場残高	88,179	87,925	87,947	92,223	88,728
									うち無担	67,724	67,168	67,116	70,840	64,245
									うちO/N	41,619	40,833	41,366	45,710	42,685
									うち有担	20,455	20,757	20,831	21,383	24,483

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
10年利付国債	347	0.10%	23,000	2017/8/3	2027/6/20	78,263.0	18,581.0	100.2500	0.0740%	86.8954%	100.2600	0.0730%	4,404.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/8/9	2018/2/7	152,526.0	10,500.12		0.0000%	6.9320%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	44,274	2017/8/1	2017/8/2		379	379		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/8/3	2017/8/10	1.66	1	1				

●2017年8月2日の予定

- *布野日銀審議委員、札幌市金融経済懇談会にて講演
- *7月実績/8月見込み財政資金対民間収支
- *7月のマネタリーベース
- *7月の消費動向調査

◆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