

Central Daily Market Report

2017年8月8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8日		2017年8月9日		2017年8月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 400		▲ 1,000	
財政	1,400		▲ 5,000		▲ 8,000	
資金過不足	1,100		▲ 5,400		▲ 9,000	
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	9,200					
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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	500		400			
国債補完供給	▲ 300			300		
当預増減	15,400		▲ 4,900		▲ 9,000	
当座預金残高	3,581,800		3,576,900		3,567,900	
準備預金残高	3,205,000					
積み終了先	3,204,600				8月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,204,600				積数	3,200
非準備預金先	376,800				1日平均	500
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額						3,008,500
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	77.42%		

●2017年8月8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1兆9,000億円増加の320兆9,000億円(当座預金残高見込みは358兆2,000億円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.086~▲0.045%、地銀業態から▲0.06~▲0.03%、信託・証券業態などから▲0.06~▲0.045%近辺の調達希望で始まった。引き続き調達ニーズの強い展開となり、朝方は▲0.045~▲0.03%のレンジで出合い。一巡後も▲0.05~▲0.045%で散発的にビッドが入り、出合いが見られた。ターム物は、特段目立った動きは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(8/9-8/10)は▲0.08~▲0.07%程度、S/N(8/10-8/14)は▲0.07%程度での出合いとなった。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などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先T/Nは低位横ばいで推移。本日は6M物の入札が実施され、WI取引で▲0.117~▲0.115%での出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1150%・按分落札利回▲0.1131%と、概ね予想通りの結果となった。セカンダリー市場では、6M物で▲0.117~▲0.113%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先S/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、5・10日に係る発行となり、幅広い業態からの発行案件が見られ、償還総額1,500億円程度に対し発行総額は2,100億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移したが、一部の銘柄では強めに決着するものも散見された。

●短期金融市場関連指標

2017/8/8	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.080	0.065	0.000	19,996.01	▲ 59.88	110.76-78	110.58-60
T/N			▲ 0.035				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.091						
3W			0.005				-	▲ 0.094						
1M			▲ 0.048				-	▲ 0.098						
3M								▲ 0.111						
6M								▲ 0.114						
1Y								▲ 0.110						
									日付	8/1	8/2	8/3	8/4	8/7
									日銀当預残	3,641,000	3,581,600	3,564,200	3,576,400	3,566,400
									準備預金残	3,238,200	3,176,000	3,180,000	3,191,400	3,193,600
									マネタリーベース	4,695,300	4,635,700	4,618,700	4,631,200	4,620,600
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.063%	▲0.057%	▲0.054%	▲0.049%
									コール市場残高	90,933	91,264	86,176	90,518	86,104
									うち無担	69,656	69,946	63,560	68,516	63,405
									うちO/N	46,696	46,086	40,280	46,181	42,690
									うち有担	21,277	21,318	22,616	22,002	22,699

●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)
国庫短期証券	700	-	26,000	2017/8/10	2018/2/13	99,362.0	21,339.5	100.0580	▲0.1131%	68.5647%	100.0590	▲0.1150%	4,660.0
30年利付国債	55	0.80%	8,000	2017/8/10	2047/6/20	25,245.0	6,472.0	98.1000	0.8800%	12.8466%	98.2000	0.8760%	1,519.0
エネルギー対策	-	-	7,000	2017/8/21	2018/8/20	84,304.0	6,999.93		0.0000%	8.4082%		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
CP等買入	3,000	2017/8/14			7,027	2,972	▲0.005		▲0.001	12.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	42,220	2017/8/8	2017/8/9		314	314		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/8/10	2017/8/17	1.66	1	1				

●2017年8月9日の予定

*7月のマネーストック	*米6月の卸売売上高	*国庫短期証券(701回)入札(3ヶ月、44,000億円、8/14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