

# Central Daily Market Report

2017年8月10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10日		2017年8月14日		2017年8月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		700			0
財政	▲ 2,800		▲ 7,500			53,000
資金過不足	▲ 4,100		▲ 6,800			53,000
<b>金融調節</b>	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			1,500	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						7,500
国債買入			8,100			7,400
CP等買入		▲ 900	3,000	▲ 400		
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	100					
国債補完供給		300				
当預増減	▲ 4,600		3,900			67,900
当座預金残高	3,572,000		3,575,900			3,643,800
準備預金残高	3,204,900					
積み終了先	3,204,300				8月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,204,300				積数	300
非準備預金先	367,100				1日平均	200
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	99.99%	日数	93.55%		

## ●2017年8月10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1兆3,000億円増加の320兆5,000億円(当座預金残高見込みは357兆2,000億円)。本日の無担O/N物は、大手行から▲0.086~▲0.03%、地銀業態から▲0.035~▲0.02%、信託・証券業態などから▲0.035~▲0.025%近辺の調達希望で始まった。連休を挟んで積みの最終週を迎えることもあり調達意欲は強く、朝方は▲0.03~▲0.02%のレンジで出合い。一巡後は▲0.045~▲0.03%近辺での出合い水準で推移し、本日の取引を終了した。ターム物の出合いはロール案件中心の取引であった。

### <レポ市場>

GC T/N(8/14-8/15)は▲0.070%程度、S/N(8/15-8/16)は▲0.075%程度を中心とした出合いとなった。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、20Y154~161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。市場予想通りの7,500億円で実施された短国買入オペは、平均落札利回較差▲0.002%、按分落札利回較差▲0.004%と直前の堅調なマーケットを反映したこじつかりの結果となった。3M物で▲0.118~▲0.115%、6M物で▲0.125~▲0.12%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、発行・償還共に1,500億円程度であった。一部の小売・ゴム製品業態において大型案件が見られたものの、概ね落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/8/10	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.079	0.055	0.000	19,729.74	▲ 8.97	110.03-04	110.00-02
T/N							-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.091						
3W	▲ 0.015	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.116	▲ 0.109						
6M							▲ 0.122	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.148						
									日付	8/3	8/4	8/7	8/8	8/9
									日銀当預残	3,564,200	3,576,400	3,566,400	3,581,800	3,576,600
									準備預金残	3,180,000	3,191,400	3,193,600	3,205,000	3,189,100
									マネタリーベース	4,618,700	4,631,200	4,620,600	4,636,300	4,631,600
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.054%	▲0.049%	▲0.042%	▲0.033%
									コール市場残高	86,176	90,518	86,104	85,833	88,159
									うち無担	63,560	68,516	63,405	64,935	67,746
									うちO/N	40,280	46,181	42,690	42,854	44,835
									うち有担	22,616	22,002	22,699	20,898	20,413

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/8/23	2018/2/22	129,197.0	10,500.17		0.0000%	8.1940%		0.0000%	

## ●オペ結果

種類	オフター額(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
国庫短期証券買入	7,500	2017/8/15			25,043	7,500	▲0.004		▲0.002	90.6
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2017/8/15			3,317	1,005	0.003		0.006	36.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/8/15			14,930	2,803	0.005		0.005	74.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2017/8/15			12,648	3,304	0.003		0.004	4.9
国債買入(物価連動債)	250	2017/8/15			1,342	251	▲0.130		▲0.186	45.7

## ●2017年8月11日の予定

\*山の日

\*米国7月の消費者物価指数

## ●2017年8月14日の予定

\*4-6月期のGDP1次速報(市場予想:前期比年率+2.5%)

◆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