

# Central Daily Market Report

2017年8月21日(月)  
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21日		2017年8月22日		2017年8月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		600			0
財政	▲ 47,600		900			2,000
資金過不足	▲ 46,700		1,500			2,000
<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	▲ 1,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入			10,700			
CP等買入		▲ 100	3,000	▲ 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			700			
国債補完供給	▲ 200	800		200		
当預増減	▲ 46,000		23,500			2,000
当座預金残高	3,603,900		3,627,400			3,629,400
準備預金残高	3,188,400					
積み終了先	3,182,100				8月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,181,900				積数	20,600
非準備預金先	415,500				1日平均	800
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額						2,997,900
準備預金進捗率	実績	99.31%	日数	19.35%		

## ●2017年8月21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4兆6,000億円減少の319兆4,000億円(当座預金残高見込みは360兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは国内勢より▲0.07~▲0.045%の調達希望で始まった。調達意欲は低下基調で、立ち上がりは▲0.07~▲0.045%の出合い。一巡後は調達意欲が弱く、▲0.075%近辺の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は1W物の出合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(8/22-8/23)は▲0.100~▲0.095%、S/N(8/23-8/24)は▲0.105~▲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・131、10Y336~347などにビッドの出入りが目立った。

### <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、動意無く閑散な地合いで、3M物で▲0.15~▲0.145%で少額の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移。CP発行市場は500億円強の償還に対して、900億円弱の発行となり、不動産業態からは大型発行が実施された。発行レートは、一部で強含む銘柄も見られたものの、概ね横ばい圏での決着となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/8/21	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	▲ 0.053				-	▲ 0.096	0.030	▲ 0.005	19,393.13	▲ 77.28	109.32-34	108.93-94
T/N							-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.099						
2W							-	▲ 0.100						
3W			0.000				-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.144	▲ 0.110						
6M							▲ 0.134	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.148						
									日付	8/14	8/15	8/16	8/17	8/18
									日銀当預残	3,576,300	3,641,600	3,642,300	3,642,900	3,649,900
									準備預金残	3,199,300	3,244,600	3,236,000	3,234,000	3,238,200
									マネタリーベース	4,631,900	4,696,500	4,697,100	4,698,000	4,705,300
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.026%	▲0.047%	▲0.049%	▲0.052%
									コール市場残高	82,830	81,748	91,322	87,206	90,973
									うち無担	63,375	62,119	69,919	66,364	70,806
									うちO/N	40,824	41,198	46,488	43,113	46,855
									うち有担	19,455	19,629	21,403	20,842	20,167

## ●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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)	24,703	2017/8/21	2017/8/22		226	226		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年8月22日の予定

\*20年利付国債入札  
(10,000億円、8/24発行)

◆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