

Central Daily Market Report

2017年8月24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24日		2017年8月25日		2017年8月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 600			1,000
財政	▲ 11,700		2,100			▲ 8,000
資金過不足	▲ 12,900		1,500			▲ 7,000
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					1,900	▲ 1,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,400			
CP等買入		▲ 400		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			900	▲ 900		
社債等買入				▲ 300		
E T F 買入	200		800			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 13,200		11,100			▲ 6,600
当座預金残高	3,612,800		3,623,900			3,617,300
準備預金残高	3,208,000					
積み終了先	3,205,000				8月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,205,000				積数	10,200
非準備預金先	404,800				1日平均	500
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	99.66%	日数	29.03%		

●2017年8月24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1兆1,000億円減少の320兆3,000億円(当座預金残高見込みは361兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは都銀・信託・地銀・証券より▲0.08~▲0.045%の調達希望で始まった。立ち上がりは昨日と概ね横ばいの▲0.075~▲0.04%の出会い。一巡後も同水準の出会いが散見され本日の取引を終えた。ターム物は1W物の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(8/25-8/28)は▲0.100~▲0.090%、S/N(8/28-8/29)は▲0.100~▲0.095%程度での出会い。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。本日は新発3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.145~▲0.141%の水準で出会いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1463%、按分落札利回▲0.1423%と強めの水準で決着した。セカンドラリーでも、一時▲0.175%の出会いも見られ、強含みで推移した。6M物は▲0.155%、1Y物は▲0.15~▲0.144%で出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は800億円弱の償還に対して、500億円程度の発行。ノンバンク業態からややまとまった発行が見られたが、全体的に件数は少なく、小型案件が中心であった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2017/8/24	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.096	0.020	▲ 0.010	19,353.77	▲ 80.87	108.90-92	109.26-27
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.039				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.030				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.162	▲ 0.110						
6M							▲ 0.137	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.148						
									日付	8/17	8/18	8/21	8/22	8/23
									日銀当預残	3,642,900	3,649,900	3,603,900	3,626,600	3,626,000
									準備預金残	3,234,000	3,238,200	3,188,400	3,211,600	3,201,300
									マネタリーベース	4,698,000	4,705,300	4,658,400	4,680,600	4,680,300
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.052%	▲0.053%	▲0.055%	▲0.040%
									コール市場残高	87,206	90,973	87,041	91,635	103,159
									うち無担	66,364	70,806	66,267	70,613	81,952
									うちO/N	43,113	46,855	42,826	47,028	57,687
									うち有担	20,842	20,167	20,774	21,022	21,207

●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	704	-	44,100	2017/8/28	2017/11/27	183,487.0	35,880.5	100.0355	▲0.1423%	43.8801%	100.0365	▲0.1463%	8,219.0
流動性供給	243	-	5,500	2017/8/28		20,407.0	5,490.00		▲0.0110%	88.7254%		▲0.0120%	

●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	2017/8/28	2017/9/11		1,932	1,932				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/8/24	2017/8/25		56	56		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/8/24	2017/8/25		1	1		▲0.500	▲0.500	

●2017年8月25日の予定

*6月都都区部・7月全国消費者物価指数
市場予想：全 国(7月)前年同月比(除く生鮮)：+0.5%
市場予想：東京都都区部(8月)前年同月比(除く生鮮)：+0.3%
*7月の企業向けサービス価格指数

*米国7月の耐久財新規受注

◆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お客様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