

Central Daily Market Report

2017年9月5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9月5日		2017年9月6日		2017年9月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		400		0	
財政	▲ 4,800		2,500		2,000	
資金過不足	▲ 3,800		2,900		2,000	
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	1,000					
国債買入	10,000		4,200			
CP等買入		▲ 700		▲ 600		
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		300			
国債補完供給	▲ 1,800	100	1,800			
当預増減	4,900		8,600		2,000	
当座預金残高	3,607,400		3,616,000		3,618,000	
準備預金残高	3,197,000					
積み終了先	3,196,900					
超過準備	3,196,800					
非準備預金先	410,400					
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					2,994,300	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	67.74%		

●2017年9月5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7,000億円増の320兆9,000億円(当座預金残高見込みは361兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、信託・外銀・証券業態より▲0.075~▲0.07%、地銀業態より▲0.075~▲0.045%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは弱く、一巡後は、▲0.08~▲0.075%の出合いが散見された程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ショートターム物で数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(9/6-9/7)は▲0.115~▲0.10%、S/N(9/7-9/8)は▲0.115~▲0.105%程度での出合い。引き続き資金調達ニーズが乏しく、▲0.10%を下回る水準での取引が中心となっていた。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、10Y334~347、SL158~161、30Y51~55などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先S/Nは、小幅低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.21%で少額出合った程度だった。

<CP市場>

現先レートは、低位横ばいで推移した。CP発行市場は、商社、石油業態等から大型発行が実施され、発行総額は1,000億円程度となり、償還総額の600億円程度を上回った。発行レートは引き続き0%近辺での決着が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2017/9/5	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.100	0.010	0.019	19,385.81	▲ 122.44	109.78-80	109.45-46
T/N							-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.043				-	▲ 0.107						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.108						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.155						
3M			▲ 0.015				▲ 0.217	▲ 0.124						
6M							▲ 0.150	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.154						
									日付	8/29	8/30	8/31	9/1	9/4
									日銀当預残	3,629,100	3,636,700	3,636,100	3,629,800	3,602,500
									準備預金残	3,215,600	3,224,400	3,223,800	3,216,200	3,207,500
									マネタリーベース	4,684,600	4,692,300	4,691,900	4,685,700	4,657,400
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.059%	▲0.066%	▲0.063%	▲0.064%
									コール市場残高	95,974	90,137	82,513	96,124	97,182
									うち無担	73,153	67,048	62,336	71,731	74,510
									うちO/N	46,968	42,753	40,451	47,616	48,825
									うち有担	22,821	23,089	20,177	24,393	22,672

●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)
10年利付国債	348	0.10%	23,000	2017/9/20	2027/9/20	73,695.0	18,651.00	100.8300	0.0160%	57.7604%	100.8800	0.0110%	4,343.0

●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)	50,000	2017/9/5	2017/9/6		1,638	1,638		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	38,836	2017/9/5	2017/9/6		114	114		▲0.600	▲0.600	

●2017年9月6日の予定

*7月の毎月動労統計調査速報	*米国ページブック *米国8月のISM非製造業景況指数	*国庫短期証券(706回)入札 (6ヶ月、26,000億円、9/11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