

# Central Daily Market Report

2017年9月6日(水)

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6日		2017年9月7日		2017年9月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		100		0	
財政	▲ 900		3,700		1,000	
資金過不足	▲ 400		3,800		1,000	
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						
国債買入	4,200				4,400	
CP等買入		▲ 600		▲ 300		
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	300		100			
国債補完供給		1,800				
当増減	5,300		3,600		5,400	
当座預金残高	3,612,700		3,616,300		3,621,700	
準備預金残高	3,204,200					
積み終了先	3,204,000					
超過準備	3,204,000					
非準備預金先	408,500					
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	99.97%	日数	70.97%		

## ●2017年9月6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、前日比横ばいの320兆9,000億円(当座預金残高見込みは361兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀業態より▲0.075%、信託・外銀・証券業態より▲0.075~▲0.065%、地銀業態より▲0.075~▲0.045%での調達で始まった。ビッド件数がやや増加してきているものの、レート水準に大きな変化は無く、一巡後は、▲0.075%近辺で案件の出合いが見ら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案件の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(9/7-9/8)は▲0.115~▲0.095%、S/N(9/8-9/11)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、レートは▲0.10%を下回る水準での取引が中心となっており、閑散とした地合いが続いている。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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引においては、特段の出合いが見られなかったものの、入札結果は平均落札利回▲0.1983%、按分落札利回▲0.1823%と品薄感を反映してか、堅調な結果となった。入札後は、6M物が▲0.185~▲0.18%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは、低位横ばい。CP発行市場は、商社、機械業態等から大型発行が実施され、発行総額は1,200億円弱となったものの、償還総額が1,800億円程度となり、償還超のマーケットであった。発行レートは横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/9/6	無担(速報)			有担(速報)			短期	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				-	▲ 0.101	0.005	▲ 0.005	19,357.97	▲ 27.84	108.60-61	108.78-80
T/N							-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.047				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.055	▲ 0.050	▲ 0.053				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.152						
3M							▲ 0.203	▲ 0.123						
6M							▲ 0.179	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.154						
									日付	8/30	8/31	9/1	9/4	9/5
									日銀当預残	3,636,700	3,636,100	3,629,800	3,602,500	3,607,400
									準備預金残	3,224,400	3,223,800	3,216,200	3,207,500	3,197,000
									マネタリーベース	4,692,300	4,691,900	4,685,700	4,657,400	4,661,200
									無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.066%	▲0.063%	▲0.064%	▲0.064%
									コール市場残高	90,137	82,513	96,124	97,182	99,588
									うち無担	67,048	62,336	71,731	74,510	77,218
									うちO/N	42,753	40,451	47,616	48,825	51,563
									うち有担	23,089	20,177	24,393	22,672	22,370

## ●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)	募入最低値	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	706	-	26,000	2017/9/11	2018/3/12	71,896.0	21,161.60	100.0910	▲0.1823%	27.0561%	100.0990	▲0.1983%	4,838.0

## ●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/9/8			15,610	4,116	▲0.005		▲0.004	16.4
国債買入(物価連動債)	250	2017/9/8			1,466	250		▲0.230	▲0.240	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,916	2017/9/6	2017/9/7		9	9		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/9/6	2017/9/7		2	2		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/9/8	2017/9/14	1.66	2	2				

## ●2017年9月7日の予定

*7月の景気動向指数速報	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(707回)入札
*8月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*ユーロ圏4-6月期のGDP確報値	(3ヶ月、44,000億円、9/11発行)
		*30年利付国債入札
		(8,000億円、9/20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