

# Central Daily Market Report

2017年9月7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9月7日		2017年9月8日		2017年9月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		500		1,000	
財政	2,800		0		▲ 3,000	
資金過不足	2,900		500		▲ 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					2,000	▲ 1,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,500			
CP等買入		▲ 300		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入	100					
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	2,600		4,600		▲ 1,900	
当座預金残高	3,615,300		3,619,900		3,618,000	
準備預金残高	3,206,400					
積み終了先	3,206,300					
超過準備	3,206,300					
非準備預金先	408,900					
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					3,012,400	
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	74.19%		

## ●2017年9月7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3,000億円増の321兆2,000億円(当座預金残高見込みは361兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀業態から▲0.075~▲0.073%、信託・外銀・証券業態より▲0.07~▲0.065%、地銀業態より▲0.073~▲0.045%での調達で始まった。一巡後は、▲0.08~0.075%で散発的な出合いが見られ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(9/8-9/11)は▲0.105~▲0.095%、S/N(9/11-9/12)は▲0.10~▲0.09%程度での出合い。S/Nは短国の3M物・6M物の発行が入ることでオフサイドのニーズがやや厚くなり、レートは上昇した。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、小幅上昇した。アウトライト市場では、3M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▲0.2040%、按分落札利回▲0.1864%と期末を控えた需要から、堅調な結果となった。入札後は、▲0.19~▲0.182%で出合った。この他に、6M物が▲0.19~▲0.185%で出合った。

### <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、鉄鋼業態等から大型発行案件が実施され、発行総額は1,000億円弱となったものの、償還総額が1,600億円程度弱となり、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。本日は、CP等買入オベが3,500億円(前日比+500億円)で実施された。結果は、平均落札レート▲0.005%、按分落札レート▲0.029%と応札可能銘柄が多かったことに加え、特定銘柄が応札可能であったことから、按分、平均ともにレートは前回(平均▲0.026%、按分▲0.040%)よりも上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/9/7	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	▲ 0.064				-	▲ 0.101	0.010	0.005	19,396.52	38.55	109.14-16	108.99-01
T/N	▲ 0.065	▲ 0.060	▲ 0.065				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.106						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.106						
3W	▲ 0.060	▲ 0.055	▲ 0.058				-	▲ 0.141						
1M			▲ 0.048				-	▲ 0.145						
3M							▲ 0.186	▲ 0.122						
6M							▲ 0.184	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.154						
									日付	8/31	9/1	9/4	9/5	9/6
									日銀当預残	3,636,100	3,629,800	3,602,500	3,607,400	3,612,700
									準備預金残	3,223,800	3,216,200	3,207,500	3,197,000	3,204,200
									マネタリーベース	4,691,900	4,685,700	4,657,400	4,661,200	4,666,100
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.063%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.064%
									コール市場残高	82,513	96,124	97,182	99,588	97,302
									うち無担	62,336	71,731	74,510	77,218	75,809
									うちO/N	40,451	47,616	48,825	51,563	50,654
									うち有担	20,177	24,393	22,672	22,370	21,493

## ●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	707	-	44,200	2017/9/11	2017/12/11	115,394.0	36,217.5	100.0465	▲0.1864%	12.3832%	100.0509	▲0.2040%	7,982.0
30年利付国債	56	0.80%	8,000	2017/9/20	2047/9/20	24,165.0	6,583.0	99.0000	0.8410%	66.9438%	99.2100	0.8320%	1,412.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/9/11	2017/9/25		1,985	1,985				
CP等買入	3,500	2017/9/12			8,058	3,500	▲0.029		▲0.005	5.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/9/7	2017/9/8		65	65		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,672	2017/9/7	2017/9/8		0	0				

## ●2017年9月8日の予定

*4-6月期のGDP2次速報 (市場予想：前期比年率+2.9%)	*米国7月の卸売売上高	*エネルギー対策借入 (6,500億円、9/20借入)
*7月の国際収支	*米国7月の消費者信用残高	
*8月の景気ウォッチャー調査		

◆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