

Central Daily Market Report

2017年9月8日(金)

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8日		2017年9月11日		2017年9月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		1,300			0
財政	200		▲ 7,000			1,000
資金過不足	800		▲ 5,700			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			2,000	▲ 1,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						7,500
国債買入	4,500					8,800
CP等買入		▲ 500		▲ 500		3,500
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
E T F買入						
国債補完供給		100				
当預増減	4,900		▲ 6,300			20,800
当座預金残高	3,620,200		3,613,900			3,634,700
準備預金残高	3,218,600					
積み終了先	3,218,400				9月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,218,400				積数	500
非準備預金先	401,600				1日平均	100
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	99.98%	日数	83.87%		

●2017年9月8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6,000億円増の321兆8,000億円(当座預金残高見込みは362兆円)。本日の無担O/Nは、信託・外銀・証券業態より▲0.078~▲0.065%、地銀業態より▲0.075~▲0.045%での調達で始まった。週末ではあったものの、都銀業態から積極的な調達が入らなかった事から、ビッドサイドに取り上げる動きは見られなかった。ターム物は、ショートターム物を中心に数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(9/11-9/12)は▲0.095~▲0.085%、S/N(9/12-9/13)は▲0.105~▲0.095%程度での出合い。S/Nは日銀の国債・短国の買入オペアがオファーされることで資金調達サイドが様子見姿勢となり、再びレートは▲0.10%前後の水準に低下した。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、小幅低下した。アウトライト市場では、短国買入オペアが予想上限の7,500億円で実施された。結果は、平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差+0.005%と業者の在庫の積み上がりを反映してか小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.178~▲0.17%、6M物が▲0.193~▲0.19%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、機械業態等から大型発行案件が実施されたものの、発行総額は700億円程度にとどまった。償還総額も700億円程度であった。発行レートは、引き続き0%近辺での決着が中心だった。

●短期金融市場関連指標

2017/9/8	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	▲ 0.065				-	▲ 0.098	▲ 0.010	▲ 0.020	19,274.82	▲ 121.70	108.25-26	107.74-75
T/N							-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	0.000	▲ 0.029				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.022				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.150						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.138						
3M							▲ 0.185	▲ 0.120						
6M							▲ 0.184	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.154						
									日付	9/1	9/4	9/5	9/6	9/7
									日銀当預残	3,629,800	3,602,500	3,607,400	3,612,700	3,615,300
									準備預金残	3,216,200	3,207,500	3,197,000	3,204,200	3,206,400
									マネタリーベース	4,685,700	4,657,400	4,661,200	4,666,100	4,668,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.063%	▲ 0.064%	▲ 0.064%	▲ 0.064%	▲ 0.064%
									コール市場残高	96,124	97,182	99,588	97,302	97,025
									うち無担	71,731	74,510	77,218	75,809	73,849
									うちO/N	47,616	48,825	51,563	50,654	48,624
									うち有担	24,393	22,672	22,370	21,493	23,176

●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)
エネルギー対策	-	-	6,500	2017/9/20	2018/9/20	82,040.0	6,499.97		0.0000%	8.0321%		0.0000%	

●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
国庫短期証券買入	7,500	2017/9/12			20,428	7,501	0.005		0.007	90.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/9/12			8,380	2,803	0.001		0.003	66.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/9/12			8,244	3,004	▲ 0.008		▲ 0.007	91.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/9/12			6,181	2,010	▲ 0.007		▲ 0.005	44.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/9/12			2,259	1,001	▲ 0.019		▲ 0.013	62.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/9/8	2017/9/11		30	30		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年9月11日の予定

*7月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+4.4%)
*7月の特定サービス産業動態統計速報
*7月の第3次産業活動指数

*8月のマネーストック

◆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