

Central Daily Market Report

2017年9月11日(月)
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11日		2017年9月12日		2017年9月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,300		600		0	
財政	▲ 8,100		8,500		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 6,800		9,100		▲ 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			7,500			
国債買入			9,300			
CP等買入		▲ 500	3,500	▲ 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		▲ 200		▲ 200		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 400			400		
当預増減	▲ 7,800		29,300		▲ 2,000	
当座預金残高	3,612,400		3,641,700		3,639,700	
準備預金残高	3,238,400					
積み終了先	3,238,200				9月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,238,200				積数	400
非準備預金先	374,000				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	99.99%	日数	87.10%		

●2017年9月11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、前営業日比1兆5,000億円増の323兆3,000億円(当座預金残高見込みは361兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、信託・証券業態より▲0.075~▲0.065%、地銀業態より▲0.075~▲0.055%での調達で始まった。積み最終週に入ったが、取り急ぐ動きは見られず、出会い巡後は、閑散とした状況のなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出会いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(9/12-9/13)は▲0.10~▲0.09%、S/N(9/13-9/14)は▲0.095~▲0.09%程度での出会い。T/N、S/Nともに投資家の資金調達意欲が見られている。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、10Y336~347、SL158~161、30Y51~55などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散なマーケットであった。

<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、石油業態から大型発行案件が見られたものの、1,200億円程度の償還に対して発行は1,300億円程度と、ほぼ変わらずであった。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

2017/9/11	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)																																																				
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.098		▲ 0.005	0.005	19,545.77	270.95	108.24-25	108.42-43																																																						
T/N			0.000				-	▲ 0.093																																																													
S/N							-	-																																																													
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.020				-	▲ 0.102																																																													
2W							-	▲ 0.103																																																													
3W			0.030				-	▲ 0.150																																																													
1M			0.035				-	▲ 0.135																																																													
3M							▲ 0.183	▲ 0.120																																																													
6M							▲ 0.184	▲ 0.130																																																													
1Y							▲ 0.151	▲ 0.152																																																													
<table border="1"> <thead> <tr> <th>日付</th> <th>9/4</th> <th>9/5</th> <th>9/6</th> <th>9/7</th> <th>9/8</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>日銀当預残</td> <td>3,602,500</td> <td>3,607,400</td> <td>3,612,700</td> <td>3,615,300</td> <td>3,620,200</td> </tr> <tr> <td>準備預金残</td> <td>3,207,500</td> <td>3,197,000</td> <td>3,204,200</td> <td>3,206,400</td> <td>3,218,600</td> </tr> <tr> <td>マネタリーベース</td> <td>4,657,400</td> <td>4,661,200</td> <td>4,666,100</td> <td>4,668,600</td> <td>4,672,900</td> </tr> <tr> <td>無担O/N加重平均</td> <td>▲0.064%</td> <td>▲0.064%</td> <td>▲0.064%</td> <td>▲0.064%</td> <td>▲0.065%</td> </tr> <tr> <td>コール市場残高</td> <td>97,182</td> <td>99,588</td> <td>97,302</td> <td>97,025</td> <td>95,444</td> </tr> <tr> <td>うち無担</td> <td>74,510</td> <td>77,218</td> <td>75,809</td> <td>73,849</td> <td>71,727</td> </tr> <tr> <td>うちO/N</td> <td>48,825</td> <td>51,563</td> <td>50,654</td> <td>48,624</td> <td>44,902</td> </tr> <tr> <td>うち有担</td> <td>22,672</td> <td>22,370</td> <td>21,493</td> <td>23,176</td> <td>23,717</td> </tr> </tbody> </table>																日付	9/4	9/5	9/6	9/7	9/8	日銀当預残	3,602,500	3,607,400	3,612,700	3,615,300	3,620,200	準備預金残	3,207,500	3,197,000	3,204,200	3,206,400	3,218,600	マネタリーベース	4,657,400	4,661,200	4,666,100	4,668,600	4,672,900	無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.065%	コール市場残高	97,182	99,588	97,302	97,025	95,444	うち無担	74,510	77,218	75,809	73,849	71,727	うちO/N	48,825	51,563	50,654	48,624	44,902	うち有担	22,672	22,370	21,493	23,176	23,717
日付	9/4	9/5	9/6	9/7	9/8																																																																
日銀当預残	3,602,500	3,607,400	3,612,700	3,615,300	3,620,200																																																																
準備預金残	3,207,500	3,197,000	3,204,200	3,206,400	3,218,600																																																																
マネタリーベース	4,657,400	4,661,200	4,666,100	4,668,600	4,672,900																																																																
無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.065%																																																																
コール市場残高	97,182	99,588	97,302	97,025	95,444																																																																
うち無担	74,510	77,218	75,809	73,849	71,727																																																																
うちO/N	48,825	51,563	50,654	48,624	44,902																																																																
うち有担	22,672	22,370	21,493	23,176	23,717																																																																

●入札結果

名称	回数	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)	41,500	2017/9/11	2017/9/12		420	420		▲0.600	▲0.600	

●2017年9月12日の予定

*英国8月の消費者物価指数	*5年利付国債入札(22,000億円、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