

Central Daily Market Report

2017年9月12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12日 需給速報	2017年9月13日 需給予想	2017年9月14日 当社予想
銀行券	600	300	▲ 1,000
財政	6,200	▲ 400	2,000
資金過不足	6,800	▲ 100	1,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
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	3,500	▲ 300	▲ 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	
E T F買入			
国債補完供給	▲ 700	400	700
当預増減	26,300	300	1,000
当座預金残高	3,638,700	3,639,000	3,640,000
準備預金残高	3,246,000		
積み終了先	3,245,800		9月13日以降の残り所要積立額
超過準備	3,245,800		積数
非準備預金先	392,700		1日平均
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
			90.32%

●2017年9月12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2兆7,000億円増の326兆円(当座預金残高見込みは364兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀業態から▲0.078~▲0.075%、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。昨日までと同様に、調達ニーズは弱く、出合い一巡後は、閑散とした状況のなか本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(9/13-9/14)は▲0.09~▲0.08%、S/N(9/14-9/15)は▲0.09~▲0.08%程度での出合い。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>

現先レートは低位横ばいで推移した。アウトライト市場は、引き続き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、不動産業態から大型発行案件が見られ、1,400億円程度の償還に対して発行は1,900億円程度と、発行超のマーケットとなった。発行レートは、引き続き0%近辺での決着ながら、CPオベ減額(3,500億円→2,500億円)による売却への期待感の後退から、レートは若干上昇気味となっている。

●短期金融市場関連指標

2017/9/12	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.078	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.093	0.015	0.020	19,776.62	230.85	109.39-41	109.54-56		
T/N			▲ 0.050				-	▲ 0.087								
S/N							-	-								
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.098								
2W			▲ 0.055				-	▲ 0.098								
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.139								
1M							-	▲ 0.128								
3M							▲ 0.180	▲ 0.121								
6M							▲ 0.184	▲ 0.130								
1Y							▲ 0.151	▲ 0.152								
											日付	9/5	9/6	9/7	9/8	9/11
											日銀当預残	3,607,400	3,612,700	3,615,300	3,620,200	3,612,400
											準備預金残	3,197,000	3,204,200	3,206,400	3,218,600	3,238,400
											マネタリーベース	4,661,200	4,666,100	4,668,600	4,672,900	4,663,800
											無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.065%	▲0.064%
											コール市場残高	99,588	97,302	97,025	95,444	98,520
											うち無担	77,218	75,809	73,849	71,727	74,945
											うちO/N	51,563	50,654	48,624	44,902	47,800
											うち有担	22,370	21,493	23,176	23,717	23,575

●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)
5年利付国債	133	0.10%	22,000	2017/9/20	2022/9/20	72,342.0	17,777.00	101.0300	▲0.1040%	47.7913%	101.0600	▲0.1100%	4,216.0

●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)	20,000	2017/9/12	2017/9/13		346	346		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	19,286	2017/9/12	2017/9/13		290	290		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/9/14	2017/9/21	1.66	2	2				

●2017年9月13日の予定

*7-9月期の法人企業景気予測調査季報
*8月の企業物価指数
*米国8月の生産者物価指数
*米国8月の財政収支

◆本資料は信頼できると思わ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