

Central Daily Market Report

2017年9月13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13日		2017年9月14日		2017年9月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400	▲ 600	▲ 2,000			
財政	▲ 800	3,000	▲ 14,000			
資金過不足	▲ 400	2,400	▲ 16,000			
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					9,900	
CP等買入		▲ 300	▲ 500			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					33,800	▲ 4,900
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入			600			
国債補完供給	▲ 100	700	100			
当預増減	▲ 100	2,600	22,800			
当座預金残高	3,638,600	3,641,200	3,664,000			
準備預金残高	3,248,700					
積み終了先	3,248,600			9月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,248,600			積数	200	
非準備預金先	389,900			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	93.55%		

●2017年9月13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1兆3,000億円減の324兆7,000億円(当座預金残高見込みは363兆9,000億円)。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~▲0.06%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは弱く、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(9/14-9/15)は▲0.09~▲0.08%、S/N(9/15-9/19)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。オペの影響でカレント周りのショートがやや増加している。

<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、15日スタートで幅広い業態から大型発行案件が見られたものの、9月末の有利子負債圧縮の動きから、4,000億円程度の償還に対して発行は3,000億円程度と償還超のマーケットとなった。発行レートは、引き続き0%近辺が中心であった。本日はCP等買入オペが2,500億円で実施された。オファー額が前回より1,000億円減額されたこともあり、平均落札レート▲0.006%、按分落札レート▲0.015%と按分レートが前回比(前回按分▲0.029%)で上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/9/13	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.089	0.020	0.005	19,865.82	89.20	110.22-24	109.94-95
T/N			▲ 0.050				-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.050	0.010	▲ 0.036				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.125						
1M							-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.156	▲ 0.114						
6M							▲ 0.181	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.151						
									日付	9/6	9/7	9/8	9/11	9/12
									日銀当預残	3,612,700	3,615,300	3,620,200	3,612,400	3,638,700
									準備預金残	3,204,200	3,206,400	3,218,600	3,238,400	3,246,000
									マネタリーベース	4,666,100	4,668,600	4,672,900	4,663,800	4,689,400
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.065%	▲0.064%	▲0.063%
									コール市場残高	97,302	97,025	95,444	98,520	92,317
									うち無担	75,809	73,849	71,727	74,945	68,818
									うちO/N	50,654	48,624	44,902	47,800	41,873
									うち有担	21,493	23,176	23,717	23,575	23,499

●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)	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/9/15			7,923	2,804	0.003		0.005	42.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/9/15			8,782	3,002	0.005		0.007	58.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/9/15			11,815	4,104	0.008		0.011	79.6
CP等買入	2,500	2017/9/19			6,505	2,490	▲0.015		▲0.006	62.8
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	20,000	2017/9/13	2017/9/14		88	88		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2017/9/15	2021/9/15	0	33,835

●2017年9月14日の予定

*英中銀MPC結果発表	*国庫短期証券(708回)入札(3ヶ月、44,000億円、9/19発行)	*20年利付国債入札(10,000億円、9/20発行)
*米国8月の消費者物価指数		

◆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