

Central Daily Market Report

2017年9月1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1日		2017年9月4日		2017年9月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		1,000		1,000	
財政	▲ 13,800		▲ 28,200		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 13,900		▲ 27,200		▲ 4,000	
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			1,400	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入					1,000	
国債買入	7,700				9,900	
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)	4,000	▲ 4,000				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F買入			100			
国債補充供給	▲ 100	300		100		
当預増減	▲ 6,300		▲ 27,300		6,900	
当座預金残高	3,629,800		3,602,500		3,609,400	
準備預金残高	3,216,200					
積み終了先	3,216,000		9月4日以降の残り所要積立額		積数 1,600	
超過準備	3,215,800		1日平均		100	
非準備預金先	413,600					
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額					2,994,300	
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	61.29%		

●2017年9月1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1,000億円減の322兆3,000億円(当座預金残高見込みは363兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、信託・外銀・証券業態より▲0.08~▲0.065%、地銀業態より▲0.075~▲0.045%での調達で始まった。月末要因が剥落し、ビッド数はやや増加したものの、レート水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は、▲0.07%台で散発的な出合いが見られた程度で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(9/4-9/5)は▲0.095~▲0.090%、S/N(9/5-9/6)は▲0.100~▲0.095%程度での出合い。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などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先T/Nは低水準で推移。短国の需給が逼迫していることを勘案してか、短国買入オベが1,000億円を実施され、平均落札利回較差▲0.010%、按分落札利回較差▲0.017%と、品薄感が反映された堅調な結果となった。特段の出合いは見られていない。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額2,500億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と償還超であった。5・10日発行となり、一部の小売・鉄鋼・卸売業態において大型案件が見られたものの、全般的には案件数が少なく比較的落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/9/1	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.098	▲ 0.005	▲ 0.005	19,691.47	45.23	110.12-14	110.17-19
T/N	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.028				-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.101						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.105						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.230	▲ 0.121						
6M							▲ 0.150	▲ 0.128						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.154						
									日付	8/25	8/28	8/29	8/30	8/31
									日銀当預残	3,623,700	3,622,000	3,629,100	3,636,700	3,636,100
									準備預金残	3,212,300	3,220,600	3,215,600	3,224,400	3,223,800
									マネタリーベース	4,679,800	4,677,400	4,684,600	4,692,300	4,691,900
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.056%	▲0.057%	▲0.059%	▲0.066%
									コール市場残高	99,269	96,076	95,974	90,137	82,513
									うち無担	77,164	73,642	73,153	67,048	62,336
									うちO/N	50,869	47,807	46,968	42,753	40,451
									うち有担	22,105	22,434	22,821	23,089	20,177

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/9/11	2018/3/13	141,162.0	10,500.04		0.0000%	7.4976%		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	1,000	2017/9/5			5,551	1,000	▲0.017		▲0.010	66.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/9/5			12,325	2,805	0.000		0.001	94.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/9/5			9,052	3,003	▲0.001		0.001	89.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/9/5			14,016	4,105	0.001		0.001	78.7
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	36,808	2017/9/1	2017/9/4		101	101		▲0.600	▲0.600	

●2017年9月4日の予定

*8月のマネタリーベース	*米国祝日(Labor Day)
*8月実績/9月見込み財政資金対民間収支	

◆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