

# Central Daily Market Report

2017年9月19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19日		2017年9月20日		2017年9月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		300		▲ 1,000	
財政	▲ 400		34,800		1,000	
資金過不足	300		35,100		0	
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	4,400	▲ 1,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入			9,000		5,400	
CP等買入	2,500	▲ 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		▲ 100	▲ 800			
E T F買入						
国債補完供給	▲ 200		200			
当預増減	5,100		43,200		15,400	
当座預金残高	3,657,800		3,701,000		3,716,400	
準備預金残高	3,246,600					
積み終了先	3,231,000					
超過準備	3,225,100					
非準備預金先	411,200					
9月20日以降の残り所要積立額					40,000	
積数					1.500	
1日平均						
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					2,911,500	
準備預金進捗率	実績	98.63%	日数	13.33%		

## ●2017年9月19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1,000億円増の326兆円(当座預金残高見込みは365兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀業態から▲0.080~▲0.075%、信託・証券業態より▲0.075~▲0.060%、地銀業態より▲0.060~▲0.055%での調達で始まった。積みの序盤ではあるが、一部証券業態から調達ニーズが強まる動きが見える等、朝方はしっかりと出合いがみられたものの、一巡後は、閑散とした状況となり本日の取引を終えた。ターム物は、9月末を控えることもあり、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(9/20-9/21)は▲0.075~▲0.07%、S/N(9/21-9/22)は▲0.08~▲0.07%程度の出合いだった。輪番や短国買入オベの影響は限定的で、レートは前日から横ばい圏の取引だった。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、10Y336、337、340、347、30Y55などにビッドの出入りが目立った。

### <短国市場>

現先レートは小幅上昇。アウトライト市場は短国買入オベが実施された。市場での在庫の積み上がり方を考慮してか、10,000億円と多めのオファーとなった。応札額は31,540億円とそれなりに膨らみ、平均利回較差も+0.006%であったものの、按分利回較差は±0.000%(按分比率91.5%)と落ち着いた結果となった。オベ後は6M物で▲0.153%の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は機械、小売業態からまとまった発行が見られ、総額1,100億円程度に達した。発行レートは一部期越銘柄で強めの出合いも見られたものの、概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/9/19	無担(速報)			有担(速報)			短国 先買参考統計値	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.061				-	▲ 0.085	0.025	0.010	20,299.38	389.88	111.48-50	111.70-71
T/N							-	▲ 0.074						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.087						
2W			0.040				-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.125	▲ 0.113						
6M							▲ 0.150	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.147	▲ 0.151						
									日付	9/11	9/12	9/13	9/14	9/15
									日銀当預残	3,612,400	3,638,700	3,638,600	3,641,500	3,652,700
									準備預金残	3,238,400	3,246,000	3,248,700	3,255,200	3,255,900
									マネタリーベース	4,663,800	4,689,400	4,689,000	4,692,500	4,704,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.063%	▲ 0.062%	▲ 0.059%	▲ 0.060%
									コール市場残高	98,520	92,317	96,887	101,442	91,202
									うち無担	74,945	68,818	72,305	73,681	67,660
									うちO/N	47,800	41,873	46,060	46,006	41,535
									うち有担	23,575	23,499	24,582	27,761	23,542

## ●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。													

## ●オベ結果

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	10,000	2017/9/21			31,540	10,002	0.000		0.006	91.5	
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2017/9/21			2,220	1,002	0.002		0.002	99.7	
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/9/21			13,923	4,105	0.008		0.008	89.9	
国債買入(物価連動債)	250	2017/9/21			1,044	250	0.300		0.199	84.6	
社債等買入	1,250	2017/9/25			3,180	1,251	0.020		0.035	16.9	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	49,953	2017/9/19	2017/9/20		57	57		▲ 0.600	▲ 0.600		
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2017/9/19	2017/9/20		166	166		▲ 0.600	▲ 0.600		
米ドル資金供給		2017/9/21	2017/9/28	1.66		2					
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)							
被災地金融支援オベ	第77回	2017/9/22	2018/9/21	0	807						
被災地金融支援オベ(熊本)	第16回	2017/9/22	2018/9/21	0	0						

## ●2017年9月20日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、21日まで)	*米国FOMC(2日目)	*国庫短期証券(710回)入札(3ヶ月、44,000億円、9/25発行)
*4-6月期の資金循環統計速報	*米国FRB経済見通し発表	*流動性供給入札(3,000億円、9/22発行)
*8月の貿易統計	*米国8月の中古住宅販売	

◆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