

# Central Daily Market Report

2017年9月20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20日		2017年9月21日		2017年9月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 1,100			0
財政	37,400		▲ 1,800			▲ 2,000
資金過不足	37,800		▲ 2,900			▲ 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						
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		▲ 300		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					800	▲ 800
社債等買入		▲ 800		▲ 100		
E T F買入			300			
国債補完供給	▲ 400	200		400		
当預増減	45,500		13,000			▲ 2,000
当座預金残高	3,703,300		3,716,300			3,714,300
準備預金残高	3,277,100					
積み終了先	3,269,400				9月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,265,100				積数	28,000
非準備預金先	426,200				1日平均	1,100
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	99.04%	日数	16.67%		

## ●2017年9月20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2兆円増の328兆円(当座預金残高見込みは370兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から調達ニーズが強まり、調達水準は▲0.075~▲0.050%、都銀業態は▲0.080~▲0.075%、信託及び地銀業態は▲0.075~▲0.050%での調達で始まった。朝方は比較的しっかりした取引がみられていたものの、一巡後は落ち着いた状況となった。ターム物は、9月末を意識した1W程度のショートターム物の出合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(9/21-9/22)は▲0.075~▲0.07%、S/N(9/22-9/25)は▲0.08~▲0.07%程度の出合いだった。目立ったイベントは無く、レートはほぼ横ばい圏での取引だった。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、131、10Y336、337、340、などにビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライト市場は3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.125~▲0.115%の出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1074%、按分落札利回▲0.1002%と償還日が海外のクリスマス休暇にあたり、参加者が限定的だった為か、小甘い結果となった。セカンダリーは▲0.106~▲0.100%と小動きに終わった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は機械、石油業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は800億円程度にとどまった。発行レートは横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/9/20	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.057			-	▲ 0.083	0.025	0.000	20,310.46	11.08	111.59-61	111.39-40
T/N							-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.040		▲ 0.046			-	▲ 0.085						
2W				▲ 0.009			-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.108	▲ 0.113						
6M							▲ 0.151	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.147	▲ 0.151						
									日付	9/12	9/13	9/14	9/15	9/19
									日銀当預残	3,638,700	3,638,600	3,641,500	3,652,700	3,657,800
									準備預金残	3,246,000	3,248,700	3,255,200	3,255,900	3,246,600
									マネタリーベース	4,689,400	4,689,000	4,692,500	4,704,700	4,709,200
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.062%	▲0.059%	▲0.060%	▲0.061%
									コール市場残高	92,317	96,887	101,442	91,202	101,027
									うち無担	68,818	72,305	73,681	67,660	78,495
									うちO/N	41,873	46,060	46,006	41,535	48,460
									うち有担	23,499	24,582	27,761	23,542	22,532

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
国庫短期証券	710	-	44,300	2017/9/25	2017/12/25	165,610.0	37,020.4	100.0250	▲0.1002%	67.3381%	100.0268	▲0.1074%	7,279.0
流動性供給	245	-	3,000	2017/9/22		12,129.0	2,992.00		▲0.0050%	71.5239%		▲0.0070%	

## ●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)	33,722	2017/9/20	2017/9/21		368	368		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年9月21日の予定

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)

\*黒田日銀総裁、定例会見

◆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