

# Central Daily Market Report

2017年9月22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22日		2017年9月25日		2017年9月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		100			0
財政	▲ 7,200		5,300			▲ 5,000
資金過不足	▲ 8,000		5,400			▲ 5,000
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			2,400	▲ 2,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入						
CP等買入		▲ 900		▲ 600		
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			1,300	▲ 300		
E T F買入	400		400			
国債補完供給	▲ 1,700	500	1,700			
当預増減	▲ 9,700		8,300			5,000
当座預金残高	3,706,600		3,714,900			3,719,900
準備預金残高	3,288,600					
積み終了先	3,286,700				9月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,286,300				積数	16,900
非準備預金先	418,000				1日平均	800
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	99.42%	日数	30.00%		

## ●2017年9月22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1兆6,000億円増の330兆1,000億円(当座預金残高見込みは370兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託業態から▲0.080~▲0.070%、証券業態は▲0.040~▲0.030%、地銀業態▲0.070~▲0.030%での調達で始まった。週末の影響もあってか、朝方は証券・地銀業態から取り上がる展開となったものの、一巡後は、落ち着いた状況となった。ターム物は、9月末越えの出会いが数件見られた程度だった。

### <レポ市場>

GC T/N(9/25-9/26)、S/N(9/26-9/27)共に▲0.065~▲0.055%程度の出会いだった。短国買入オペアが通知されたものの、引き続き調達サイドがしっかりしており、レートは横ばい圏での取引だった。SCI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、347などにビッドの出入りが目立った。

### <短国市場>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライ市場は短国買入オペアが10,000億円実施された。オファー金額が市場予想より多かったこともあり、平均利回較差+0.002%、按分利回較差±0.000%と落ち着いた結果になった。オペア後は、引け際に6M物▲0.160~▲0.155%、1Y物▲0.155~▲0.153%の出会いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は石油、不動産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850億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

2017/9/22	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.072	0.020	▲ 0.005	20,296.45	▲ 51.03	112.45-47	112.00-02
T/N							-	▲ 0.063						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.048				-	▲ 0.140						
2W							-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.108	▲ 0.112						
6M							▲ 0.155	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.151						
									日付	9/14	9/15	9/19	9/20	9/21
									日銀当預残	3,641,500	3,652,700	3,657,800	3,703,300	3,716,300
									準備預金残	3,255,200	3,255,900	3,246,600	3,277,100	3,292,500
									マネタリーベース	4,692,500	4,704,700	4,709,200	4,754,300	4,768,300
									無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.060%	▲0.061%	▲0.057%	▲0.054%
									コール市場残高	101,442	91,202	101,027	97,093	100,448
									うち無担	73,681	67,660	78,495	74,390	77,946
									うちO/N	46,006	41,535	48,460	43,925	46,721
									うち有担	27,761	23,542	22,532	22,703	22,502

## ●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)
流動性供給	246	-	5,500	2017/9/26		15,447.0	5,476.00		▲0.0130%	94.4155%		▲0.0140%	

## ●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	10,000	2017/9/26			32,053	10,003	0.000		0.002	73.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	112,630	2017/9/22	2017/9/25		1,462	1,462		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,109	2017/9/22	2017/9/25		139	139		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年9月25日の予定

\*黒田日銀総裁、大阪経済4団体共催懇談会にて講演

\*月例経済報告

\*7月の景気動向指数改訂状況

◆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