

Central Daily Market Report

2017年9月25日(月)
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25日		2017年9月26日		2017年9月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 100		0	
財政	2,700		▲ 7,200		▲ 10,000	
資金過不足	2,700		▲ 7,300		▲ 10,000	
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					9,900	
CP等買入		▲ 600		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,300	▲ 300				
E T F 買入	400					
国債補充供給	▲ 1,400	1,700		1,400		
当預増減	4,200		3,900		▲ 100	
当座預金残高	3,710,800		3,714,700		3,714,600	
準備預金残高	3,294,600					
積み終了先	3,292,400		9月26日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,292,400		積数		14,800	
非準備預金先	416,200		1日平均		700	
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	99.49%	日数	33.33%		

●2017年9月25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6,000億円増の330兆7,000億円(当座預金残高見込みは371兆5,000億円)。本日の無担O/Nは都銀・信託業態から▲0.080~▲0.065%、証券業態は▲0.050~▲0.035%、地銀業態▲0.040~▲0.030%での調達で始まった。先週に引き続き、証券・地銀業態からの調達ニーズがしっかりとしていた。ターム物は、10月スタート物のショートタームでの出会いが数件見られた程度だった。

<レポ市場>

GC T/N(9/26-9/27)は、▲0.065~▲0.06%程度のお合い。S/N(9/27-9/28)は、▲0.07~▲0.065%程度のお合い。国債買入オペが通知され、先日のS/Nと比べ0.5bp程度レート低下となった。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、個別銘柄では5Y130、131、10Y336、347、30y51~55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。アウトライト市場は、1Y▲0.160%、3M▲0.111~▲0.109%で出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。ノンバンク等から発行が見られたが、1,900億円程の償還に対して、1,200億円弱の発行にとどまった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/9/25	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	▲ 0.042				-	▲ 0.072	0.020	0.000	20,397.58	101.13	112.44-46	112.23-25
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.135						
2W							-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.110	▲ 0.111						
6M							▲ 0.156	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.151						
									日付	9/15	9/19	9/20	9/21	9/22
									日銀当預残	3,652,700	3,657,800	3,703,300	3,716,300	3,706,600
									準備預金残	3,255,900	3,246,600	3,277,100	3,292,500	3,288,600
									マネタリーベース	4,704,700	4,709,200	4,754,300	4,768,300	4,759,500
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.061%	▲0.057%	▲0.054%	▲0.046%
									コール市場残高	91,202	101,027	97,093	100,448	98,672
									うち無担	67,660	78,495	74,390	77,946	77,288
									うちO/N	41,535	48,460	43,925	46,721	45,283
									うち有担	23,542	22,532	22,703	22,502	21,384

●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	2017/9/27			9,036	2,806	▲0.004		▲0.002	41.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/9/27			11,000	3,006	▲0.004		▲0.003	1.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/9/27			15,659	4,107	▲0.003		▲0.003	95.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	55,016	2017/9/25	2017/9/26		1,112	1,112		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	25,438	2017/9/25	2017/9/26		80	80		▲0.500	▲0.500	

●2017年9月26日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(7月19, 20日分)	*米国7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(5,000億円、9/28発行)
*8月の企業向けサービス価格指数	*米国8月の新築一戸建て販売件数	
	*米国9月のCB消費者信頼感指数	

◆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