

# Central Daily Market Report

2017年9月26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26日		2017年9月27日		2017年9月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 500			0
財政	▲ 7,100		▲ 8,800			▲ 4,000
資金過不足	▲ 7,400		▲ 9,300			▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	10,000					
国債買入			10,100			
CP等買入		▲ 200		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入			500			
国債補完供給	▲ 400	1,400		400		
当預増減	3,400		900		▲ 4,000	
当座預金残高	3,714,200		3,715,100		3,711,100	
準備預金残高	3,295,800					
積み終了先	3,294,800					
超過準備	3,293,700					
非準備預金先	418,400					
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	99.57%	日数	36.67%		

## ●2017年9月26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1兆5,000億円減の329兆2,000億円(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・地銀業態から▲0.065~▲0.035%での調達で始まった。朝方は証券・地銀業態から強めの出合いが見られたが、一巡後は、調達ニーズが弱まったためか、全般的に落ち着いた取引となった。ターム物は、9月末越え物と10月スタート物の取引が散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(9/27-9/28)は、▲0.07~▲0.065%程度の出合い。S/N(9/28-9/29)は、▲0.07~▲0.065%程度の出合い。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、個別銘柄では5Y130、131、10Y336、338、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、総じて閑散な中、3M物では▲0.109%、1Y物では▲0.165%での出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。CP発行市場は、石油業態等から大型発行が見られたものの、4,700億円弱の償還に対して、1,300億円強の発行にとどまった。発行レートは、一部で低下する案件も見られた。CP等買入オペアが2,500億円でオファーされ、平均落札レート0.006%、按分落札レート▲0.003%の結果となるなど、いずれも前回比(平均▲0.006%・按分▲0.015%)で上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/9/26	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				-	▲ 0.070	0.025	0.005	20,330.19	▲ 67.39	111.73-74	111.75-77
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.066						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.001	0.030	0.001				-	▲ 0.134						
2W							-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.110	▲ 0.112						
6M							▲ 0.156	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.152						
									日付	9/19	9/20	9/21	9/22	9/25
									日銀当預残	3,657,800	3,703,300	3,716,300	3,706,600	3,710,800
									準備預金残	3,246,600	3,277,100	3,292,500	3,288,600	3,294,600
									マネタリーベース	4,709,200	4,754,300	4,768,300	4,759,500	4,763,700
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.057%	▲0.054%	▲0.046%	▲0.042%
									コール市場残高	101,027	97,093	100,448	98,672	99,290
									うち無担	78,495	74,390	77,946	77,288	78,596
									うちO/N	48,460	43,925	46,721	45,283	46,526
									うち有担	22,532	22,703	22,502	21,384	20,694

## ●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)
40年利付国債	10	0.90%	5,000	2017/9/28	2057/3/20	16,180.0	4,994.00		1.0150%	1.4525%			

## ●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
CP等買入	2,500	2017/9/29			6,749	2,482	▲0.003		0.006	76.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,348	2017/9/26	2017/9/27		398	398		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/9/28	2017/10/5	1.63	400	400				

## ●2017年9月27日の予定

\*米国8月の耐久財新規受注

◆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。

◆本資料は何ら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