

Central Daily Market Report

2017年9月29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29日		2017年10月2日		2017年10月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		700		2,000	
財政	▲ 15,000		▲ 10,700		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 15,400		▲ 10,000		▲ 3,000	
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			2,300	▲ 4,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					7,500	
国債買入	9,100				7,100	
CP等買入	2,500	▲ 4,900		▲ 400		
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				
ETF買入						
国債補完供給	▲ 3,900			3,900		
当預増減	▲ 12,700		▲ 8,500		11,600	
当座預金残高	3,691,700		3,683,200		3,694,800	
準備預金残高	3,274,400					
積み終了先	3,273,600				10月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,272,500				積数 4,800	
非準備預金先	417,300				1日平均 300	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					2,913,100	
準備預金進捗率	実績	99.84%	日数	53.33%		

●2017年9月29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5,000億円増の327兆8,000億円(当座預金残高見込みは369兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託業態から▲0.085~▲0.075%、地銀業態から▲0.080~▲0.045%、証券業態から▲0.080~▲0.060%での調達が見られた。9月末越えの取引となったことでビッドが薄く、朝方は▲0.06%台の出合いから始まり、▲0.080~▲0.060%での取引が中心となった。ターム物は、10月スタート物のショートタームでの取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(10/2-10/3)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。S/N(10/3-10/4)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/Nは短国買入オペが入りレートが低下した。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、338、347、20Y162、30Y51~56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。本日は短国買入オペが7,500億円でおファーされた。結果は平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.001%と処分売りの動きが出たのか、やや小甘い決着となった。オペ後には、3M物で▲0.175~▲0.162%の出合いが見られるなど、償還が年末越えということもあってか、一転強含みの展開となった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は、償還総額は少額にとどまる一方で、鉄鋼・石油・商社からまとまった発行が実施され、発行総額は2,000億円程度となった。発行レートは、引き続き0%近辺での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2017/9/29	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.126	0.060	▲ 0.007	20,356.28	▲ 6.83	112.48-49	112.45-46
T/N							-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.040	▲ 0.009	▲ 0.036				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.099						
1M	▲ 0.035	0.010	▲ 0.016				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.172	▲ 0.120						
6M							▲ 0.154	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.162	▲ 0.153						
									日付	9/22	9/25	9/26	9/27	9/28
									日銀当預残	3,706,600	3,710,800	3,714,200	3,714,900	3,704,400
									準備預金残	3,288,600	3,294,600	3,295,800	3,291,900	3,284,900
									マネタリーベース	4,759,500	4,763,700	4,767,300	4,768,600	4,759,400
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.042%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.048%
									コール市場残高	98,672	99,290	95,588	94,807	95,982
									うち無担	77,288	78,596	74,284	73,531	74,574
									うちO/N	45,283	46,526	43,234	44,181	44,879
									うち有担	21,384	20,694	21,304	21,276	21,408

●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
国庫短期証券買入	7,500	2017/10/3			20,332	7,501	0.001		0.006	39.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/10/3			12,247	4,106	▲0.009		▲0.007	15.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/10/3			5,235	2,003	▲0.017		▲0.012	22.8
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/10/3			3,111	1,001	▲0.018		▲0.015	100.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	161,467	2017/9/29	2017/10/2		3,772	3,772		▲0.500	▲0.501	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2017/9/29	2017/10/2		40	40		▲0.500	▲0.500	

●2017年10月2日の予定

*9月調査の日銀短観(概要及び要旨) 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+18	*米国8月の建設支出 *米国9月のISM 製造業景況指数
---	---------------------------------

◆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