

# Central Daily Market Report

2017年9月15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15日		2017年9月19日		2017年9月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		600		▲ 1,000	
財政	▲ 9,900		▲ 1,800		28,000	
資金過不足	▲ 10,900		▲ 1,200		27,000	
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			4,400	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,000				8,800	
CP等買入		▲ 1,300	2,500	▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	33,800	▲ 21,400				
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F買入	900					
国債補充供給		200				
当預増減	11,200		3,800		35,800	
当座預金残高	3,652,700		3,656,500		3,692,300	
準備預金残高	3,255,900					
積み終了先	3,255,900					
超過準備	3,255,900				9月19日以降の残り所要積立額 積数 61,500	
非準備預金先	396,800				1日平均 2,300	
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	97.89%	日数	10.00%		

## ●2017年9月15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7,000億円増の325兆9,000億円(当座預金残高見込みは365兆円)。本日の無担O/Nは、都銀業態から▲0.08~▲0.065%、信託・証券業態より▲0.075~▲0.06%、地銀業態より▲0.075~▲0.055%での調達で始まった。積み最終日であったが、三連休で次の積み期間に掛かってくる事もあり、調達量は限定的であった。一巡後は、徐々にビッドが消え、閑散とした状況のなか本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームの出会いが複数見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(9/19-9/20)は▲0.09~▲0.08%、S/N(9/20-9/21)は▲0.075~▲0.065%程度での出会い。S/Nは国債の大量発行日にあたり、業者の売物が増加している。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5Y130~132、10Y336~347、SL158~161、30Y51~55などにビッドの出入りが見られた。

### <短国市場>

現先レートは低位横ばいで推移した。アウトライト市場は、1Y物の入札が実施され、WI取引で▲0.130%が少額出合う中、平均落札利回▲0.1308% 按分落札利回▲0.1278%と、事前予想通りの順調な結果となった。その後のセカンドリー市場では、▲0.147%まで買い進まれた。

### <CP市場>

現先レートは、低位横ばいで推移した。CP発行市場は、20日スタートにあたり商社、鉄鋼業態等から大型発行案件が見られたものの、2,000億円程度の発行に対して償還は2,200億円程度とほぼ変わらずであった。発行レートは引き続き0%近辺が中心であった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/9/15	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	▲ 0.083	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.086	0.015	▲ 0.020	19,909.50	102.06	109.93-94	110.70-72
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.045	0.025	▲ 0.027				-	▲ 0.118						
3W							-	▲ 0.112						
1M							-	▲ 0.111						
3M			0.050				▲ 0.125	▲ 0.114						
6M							▲ 0.150	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.151						
									日付	9/8	9/11	9/12	9/13	9/14
									日銀当預残	3,620,200	3,612,400	3,638,700	3,638,600	3,641,500
									準備預金残	3,218,600	3,238,400	3,246,000	3,248,700	3,255,200
									マネタリーベース	4,672,900	4,663,800	4,689,400	4,689,000	4,692,500
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.059%
									コール市場残高	95,444	98,520	92,317	96,887	101,442
									うち無担	71,727	74,945	68,818	72,305	73,681
									うちO/N	44,902	47,800	41,873	46,060	46,006
									うち有担	23,717	23,575	23,499	24,582	27,761

## ●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)
国庫短期証券	709	-	23,000	2017/9/20	2018/9/20	91,786.0	18,766.80	100.1280	▲0.1278%	64.0137%	100.1310	▲0.1308%	4,233.0

## ●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	2017/9/20			6,684	2,802	▲0.009		▲0.005	46.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/9/20			4,886	3,004	▲0.014		▲0.011	62.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/9/20			4,228	2,003	▲0.017		▲0.014	47.9
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/9/20			3,236	1,004	▲0.018		▲0.016	88.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	24,973	2017/9/15	2017/9/19		6	6		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年9月18日の予定

\*敬老の日

\*ユーロ圏8月の消費者物価指数改定値

## ●2017年9月19日の予定

\*7月の石油等消費動態統計

\*米国FOMC(1日目)

\*米国8月の住宅着工件数

◆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