

Central Daily Market Report

2017年9月21日(木)
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21日		2017年9月22日		2017年9月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 900		1,000	
財政	▲ 1,300		▲ 6,500		1,000	
資金過不足	▲ 2,400		▲ 7,400		2,000	
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	5,400					
CP等買入		▲ 100		▲ 900		
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		▲ 100			1,300	
E T F買入	300		400			
国債補完供給	▲ 500	400		500		
当預増減	13,000		▲ 7,400		3,700	
当座預金残高	3,716,300		3,708,900		3,712,600	
準備預金残高	3,292,500					
積み終了先	3,289,500					
超過準備	3,288,200					
非準備預金先	423,800					
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	99.19%	日数	20.00%		

●2017年9月21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328兆5,000億円(当座預金残高見込みは371兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀業態から▲0.080~▲0.075%、証券業態▲0.055~▲0.045%、信託・地銀業態▲0.075~▲0.045%での調達で始まり、依然として証券業態からの調達ニーズは強かった。ターム物は、9月末を意識したショートターム及び10月スタート物で散発的な出会いとなった。また、本日、金融政策決定会合にて現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/N(9/22-9/25)は▲0.08~▲0.065%、S/N(9/25-9/26)は▲0.07~▲0.06%程度の出合いだった。9/25は短国の発行日にあたり、小幅にレートが上昇した。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た。個別銘柄では5Y130、131、10Y336、340、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。アウトライト市場は全般的に閑散な中、3Mが▲0.110~▲0.102%で散発的な出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は25日発行となり鉄鋼、機械、商社業態等からまとまった発行が見られ、総額2,400億円程度に達した。発行レートは横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/9/21	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.054				-	▲ 0.082	0.025	0.000	20,347.48	37.02	112.54-56	112.54-55
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.045				-	▲ 0.136						
2W			0.000				-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.108	▲ 0.112						
6M							▲ 0.150	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.151						
									日付	9/13	9/14	9/15	9/19	9/20
									日銀当預残	3,638,600	3,641,500	3,652,700	3,657,800	3,703,300
									準備預金残	3,248,700	3,255,200	3,255,900	3,246,600	3,277,100
									マネタリーベース	4,689,000	4,692,500	4,704,700	4,709,200	4,754,300
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.059%	▲0.060%	▲0.061%	▲0.057%
									コール市場残高	96,887	101,442	91,202	101,027	97,093
									うち無担	72,305	73,681	67,660	78,495	74,390
									うちO/N	46,060	46,006	41,535	48,460	43,925
									うち有担	24,582	27,761	23,542	22,532	22,703

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2017/9/25	2017/10/10		2,386	2,386				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	9,348	2017/9/21	2017/9/22		239	239		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	26,442	2017/9/21	2017/9/22		195	195		▲0.600	▲0.600	

●2017年9月22日の予定

*流動性供給入札(5,500億円、9/26発行)

●日銀金融政策決定会合・結果

- 現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。
 - (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)
 - 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
 - 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとしつつ、金利操作方針を実現するよう運営する。
 - (2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)
 - ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 - ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

◆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