

Central Daily Market Report

2017年10月2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10月2日		2017年10月3日		2017年10月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		300		1,000	
財政	▲ 13,100		▲ 7,300		▲ 16,000	
資金過不足	▲ 12,500		▲ 7,000		▲ 15,000	
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			7,200			
CP等買入		▲ 400		▲ 100		
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						
国債補完供給	▲ 100	3,900		100		
当預増減	▲ 11,100		7,700		▲ 15,000	
当座預金残高	3,680,600		3,688,300		3,673,300	
準備預金残高	3,244,300					
積み終了先	3,243,500				10月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,243,500				積数 3,900	
非準備預金先	436,300				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	99.87%	日数	56.67%		

●2017年10月2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2兆3,000億円減少の325兆5,000億円(当座預金残高見込みは368兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、証券業態から▲0.06~▲0.04%近辺、都銀・信託業態から▲0.08~▲0.06%近辺、地銀業態から▲0.07~▲0.04%近辺の調達希望。朝方は▲0.06~▲0.03%のレンジが出合いの中心となった。期が明けたことで調達サイドの参加者が増加し、昨日対比でレートが上昇した。一巡後は▲0.06~▲0.04%のレンジで推移した。ターム物は1W~1M物程度の期間で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(10/3-10/4)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(10/4-10/5)は、▲0.100~▲0.090%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5Y130~133、10Y336~347、20Y162、30Y51~56などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先S/N物は引き続き低位で推移した。店頭見合いで、3M物で▲0.174%の出合いが見られた程度と、動意なく閑散な地合いだった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、卸売業、鉄鋼業態でまとまった額の調達が行われ、償還総額100億円弱に対し、発行総額は1,400億円弱と発行超となった。発行レートは0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/10/2	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	▲ 0.047				-	▲ 0.090	0.070	0.010	20,400.78	44.50	112.65-66	112.98-99
T/N							-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.050	0.022	▲ 0.034				-	▲ 0.099						
3W			▲ 0.035				-	▲ 0.101						
1M	▲ 0.040	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.172	▲ 0.119						
6M							▲ 0.153	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.162	▲ 0.153						
									日付	9/25	9/26	9/27	9/28	9/29
									日銀当預残	3,710,800	3,714,200	3,714,900	3,704,400	3,691,700
									準備預金残	3,294,600	3,295,800	3,291,900	3,284,900	3,274,400
									マネタリーベース	4,763,700	4,767,300	4,768,600	4,759,400	4,747,100
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.048%	▲0.063%
									コール市場残高	99,290	95,588	94,807	95,982	63,980
									うち無担	78,596	74,284	73,531	74,574	50,680
									うちO/N	46,526	43,234	44,181	44,879	37,825
									うち有担	20,694	21,304	21,276	21,408	13,300

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,972	2017/10/2	2017/10/3		110	110		▲0.600	▲0.602	

●2017年10月3日の予定

*9月実績/10月見込み財政資金対民間収支	*10年利付国債入札(23,000億円、10/5発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、10/12借入)
*9月のマネタリーベース		
*9月の消費動向調査		

◆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