

# Central Daily Market Report

2017年10月3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10月3日		2017年10月4日		2017年10月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		200		▲ 1,000	
財政	▲ 7,500		▲ 31,100		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 7,100		▲ 30,900		▲ 24,000	
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	7,500					
国債買入	7,200					
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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	100		100		
当預増減	7,500		▲ 31,000		▲ 24,000	
当座預金残高	3,688,100		3,657,100		3,633,100	
準備預金残高	3,259,400					
積み終了先	3,259,000				10月4日以降の残り所要積立額	
超過準備					積数 3,500	
非準備預金先	428,700				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	99.88%	日数	60.00%		

## ●2017年10月3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5,000億円増加の326兆円(当座預金残高見込みは368兆8,000億円)。本日の無担O/N物は、証券業態から▲0.05~▲0.04%近辺、都銀・信託業態から▲0.07~▲0.05%近辺、地銀業態から▲0.06~▲0.04%近辺の調達希望が始まった。昨日と同様、各業態からやや強めの調達希望が入り、朝方は▲0.05~▲0.03%のレンジが出合いの中心となった。一巡後は▲0.07~▲0.03%の幅広いレンジで出合いが見られた。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(10/4-10/5)は、▲0.105~▲0.10%程度の出合い。S/N(10/5-10/6)は、▲0.110~▲0.100%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物は引続き低位で推移した。アウトライト市場は3M物が▲0.174%で少額の出合いが見られた程度と、入札を控えて様子見閑散な地合いが続いていた。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、建設業、小売業態で大ロットでの発行が見られ、償還総額1,100億円程度に対し、発行総額は1,300億円程度となった。引き続き買いニーズは強く、発行レートは低位で推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2017/10/3	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.094	0.070	0.000	20,614.07	213.29	112.76-78	113.09-10
T/N							-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.025	▲ 0.032				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.040	0.018	▲ 0.032				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.105						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.172	▲ 0.120						
6M							▲ 0.152	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.152						
									日付	9/26	9/27	9/28	9/29	10/2
									日銀当預残	3,714,200	3,714,900	3,704,400	3,691,700	3,680,600
									準備預金残	3,295,800	3,291,900	3,284,900	3,274,400	3,244,300
									マネタリーベース	4,767,300	4,768,600	4,759,400	4,747,100	4,735,400
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.048%	▲0.048%	▲0.063%	▲0.047%
									コール市場残高	95,588	94,807	95,982	63,980	95,852
									うち無担	74,284	73,531	74,574	50,680	74,301
									うちO/N	43,234	44,181	44,879	37,825	49,721
									うち有担	21,304	21,276	21,408	13,300	21,551

## ●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)
10年利付国債	348	0.10%	23,000	2017/10/5	2027/9/20	78,422.0	19,200.0	100.1700	0.0820%	10.5753%	100.2200	0.0770%	3,790.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/10/12	2018/4/12	173,675.0	10,500.00		0.0000%	6.0459%		0.0000%	

## ●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)	30,691	2017/10/3	2017/10/4		87	87		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,602	2017/10/3	2017/10/4		10	10		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/10/5	2017/10/13	1.66	1	1				

## ●2017年10月4日の予定

\*10月の日銀当座預金増減要因見込み

\*米9月のISM非製造業景況指数

\*国庫短期証券(712回)入札  
(6ヶ月、23,000億円、10/10発行)

◆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