

# Central Daily Market Report

2017年10月4日(水)

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4日		2017年10月5日		2017年10月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 1,000		▲ 1,000	
財政	▲ 34,000		▲ 18,500		2,000	
資金過不足	▲ 33,800		▲ 19,500		1,000	
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						
国債買入						9,900
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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				100		
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 34,000		▲ 19,600		10,900	
当座預金残高	3,654,100		3,634,500		3,645,400	
準備預金残高	3,224,600					
積み終了先	3,224,100				10月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,224,100				積数 3,000	
非準備預金先	429,500				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	99.90%	日数	63.33%		

## ●2017年10月4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28,000億円減少の323兆2,000億円(当座預金残高見込みは365兆7,000億円)。本日の無担O/N物は、証券業態から▲0.04%近辺、都銀・信託業態から▲0.05~▲0.04%近辺、地銀業態から▲0.04~▲0.03%近辺の調達希望で始まった。積み後半に入っていることや税揚げ要因もあり、地銀業態を中心に調達ニーズが強く、朝方は▲0.04~▲0.025%のレンジが出合いの中心となった。一巡後は▲0.05~▲0.03%の出合いが見られた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(10/5-10/6)は、▲0.105~▲0.095%程度の出合い。S/N(10/6-10/10)は、▲0.140~▲0.110%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。本日は6M物の入札が実施された。WI取引で▲0.170~▲0.166%と強めの出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1643%、按分落札利回▲0.1603%と、3月末越え償還ということもあってか堅調な結果となった。セカンダリーは▲0.175~▲0.170%で推移した。その他の出合いは3M物で▲0.175~▲0.172%、1Y物で▲0.163%の水準でみられた。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、不動産、ノンバンク、鉄鋼、卸売等複数の業態でまとまった額の調達が見られ、償還総額200億円弱に対し、発行総額は2,600億円程度まで膨らんだ。発行レートについては、大きいロットの銘柄も安定的に消化されており、引き続き0%近辺の低位で推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2017/10/4	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.098	0.050	▲ 0.020	20,626.66	12.59	112.84-86	112.51-53
T/N							-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.230	▲ 0.028				-	▲ 0.103						
2W			▲ 0.008				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.106						
1M	▲ 0.025	0.005	▲ 0.015				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.172	▲ 0.120						
6M							▲ 0.172	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.152						
									日付	9/27	9/28	9/29	10/2	10/3
									日銀当預残	3,714,900	3,704,400	3,691,700	3,680,600	3,688,100
									準備預金残	3,291,900	3,284,900	3,274,400	3,244,300	3,259,400
									マネタリーベース	4,768,600	4,759,400	4,747,100	4,735,400	4,742,600
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.048%	▲0.063%	▲0.047%	▲0.043%
									コール市場残高	94,807	95,982	63,980	95,852	99,460
									うち無担	73,531	74,574	50,680	74,301	77,730
									うちO/N	44,181	44,879	37,825	49,721	51,340
									うち有担	21,276	21,408	13,300	21,551	21,730

## ●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	712	-	23,000	2017/10/10	2018/4/10	91,474.0	18,668.50	100.0800	▲0.1603%	69.4531%	100.0820	▲0.1643%	4,331.0

## ●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	応募総額(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	2017/10/6			7,862	2,804	▲0.011		▲0.009	36.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/10/6			8,620	3,004	▲0.018		▲0.015	31.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/10/6			11,220	4,104	▲0.017		▲0.015	19.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,004	2017/10/4	2017/10/5		68	68		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年10月5日の予定

*米国8月の貿易収支	*国庫短期証券(713回)入札(3ヶ月、44,000億円、10/10発行)	*10年物価連動国債入札(4,000億円、10/10発行)
*米国8月の製造業新規受注・出荷・在庫		

◆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