

# Central Daily Market Report

2017年10月5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10月5日		2017年10月6日		2017年10月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 600			1,000
財政	▲ 19,800		500			▲ 23,000
資金過不足	▲ 20,800		▲ 100			▲ 22,000
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					2,000	▲ 2,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,100			
CP等買入		▲ 300		▲ 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	100					
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 21,000		9,900		▲ 22,400	
当座預金残高	3,633,100		3,643,000		3,620,600	
準備預金残高	3,208,600					
積み終了先	3,208,200				10月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,208,200				積数	2,600
非準備預金先	424,500				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	99.91%	日数	66.67%		

## ●2017年10月5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2兆4,000億円減少の320兆8,000億円(当座預金残高見込みは363兆5,000億円)。本日の無担O/N物は、証券業態から▲0.05~▲0.03%近辺、都銀・信託業態から▲0.05~▲0.035%近辺、地銀業態から▲0.04~▲0.025%近辺の調達希望。昨日のレート上昇を受けて朝方から強めのビッドが見られたことでレートが上昇し、▲0.035~▲0.025%のレンジが出合いの中心となった。一巡後は▲0.04~▲0.03%のレンジの出合いで推移した。ターム物はショートタームを中心に調達希望が散見されたものの、オファーサイドの参加者が減少していることから出合いは乏しかった。本日の共通担保資金供給オペは、2W物8,000億円のオファーに対し、応札額2,035億円(期落ち額2,386億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T/N(10/6-10/10)は、▲0.125~▲0.100%程度の出合い。S/N(10/10-10/11)は、▲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。本日は3M物の入札が実施された。平均落札利回り▲0.1685%、按分落札利回り▲0.1617%と、前日の6M物の入札に引き続き、堅調な結果となった。セカンダリーでは▲0.175~▲0.171%の出合いが見られた。その他、6M物で▲0.177~▲0.170%、1Y物で▲0.170%の水準で出合いがみられた。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、五・十日発行に当たり、鉄鋼、ノンバンク、電気機器等の複数業態で比較的多額の発行が散見され、償還総額800億円弱に対し、発行総額は1,700億円弱と発行超のマーケットとなった。発行レートについては、特段の変化はなく低位で推移している。本日は、CP等買入オペが、前回比500億円増の3,000億円オファーされた。結果は、平均落札レート0.005%、按分落札レート▲0.003%と、前回比(平均0.006%、按分▲0.003%)で平均レートは若干低下、按分レートは横ばいとなった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/10/5	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.098	0.040	▲ 0.010	20,628.56	1.90	112.81-82	112.69-70
T/N			▲ 0.035				-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.104						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.106						
1M			0.001				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.171	▲ 0.121						
6M							▲ 0.172	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.166	▲ 0.152						
									日付	9/28	9/29	10/2	10/3	10/4
									日銀当預残	3,704,400	3,691,700	3,680,600	3,688,100	3,654,100
									準備預金残	3,284,900	3,274,400	3,244,300	3,259,400	3,224,600
									マネタリーベース	4,759,400	4,747,100	4,735,400	4,742,600	4,708,300
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.063%	▲0.047%	▲0.043%	▲0.035%
									コール市場残高	95,982	63,980	95,852	99,460	98,591
									うち無担	74,574	50,680	74,301	77,730	76,736
									うちO/N	44,879	37,825	49,721	51,340	49,336
									うち有担	21,408	13,300	21,551	21,730	21,855

## ●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	713	-	44,000	2017/10/10	2018/1/15	140,005.0	35,695.8	100.0430	▲0.1617%	27.2022%	100.0448	▲0.1685%	8,304.0
物価連動10年	22	0.10%	4,000	2017/10/10	2027/3/10	12,378.0	3,994.00	104.5000	▲0.3610%	55.6088%			

## ●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	2017/10/10	2017/10/23		2,035	2,035				
CP等買入	3,000	2017/10/11			7,558	2,985	▲0.003		0.005	31.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	23,655	2017/10/5	2017/10/6		73	73		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年10月6日の予定

*8月の景気動向指数速報	*米国8月の卸売売上高	*交付税特別会計借入
*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国8月の消費者信用残高	(10,500億円、10/19借入)
*9月の毎月勤労統計調査速報	*米国9月の雇用統計	

◆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