

# Central Daily Market Report

2017年10月6日(金)

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6日		2017年10月10日		2017年10月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		800		1,000	
財政	▲ 2,500		▲ 24,000		1,000	
資金過不足	▲ 3,100		▲ 23,200		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			2,000	▲ 2,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入	10,100				7,100	
CP等買入		▲ 200		▲ 500	3,000	
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	▲ 300	100		300		
当預増減	6,600		▲ 23,800		22,100	
当座預金残高	3,639,700		3,615,900		3,638,000	
準備預金残高	3,219,600					
積み終了先	3,219,400					
超過準備	3,219,100					
非準備預金先	420,100					
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					2,921,600	
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	80.00%		

## ●2017年10月6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1兆2,000億円増加の322兆円(当座預金残高見込みは364兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、証券業態から▲0.04~▲0.03%近辺、都銀・信託業態から▲0.04~▲0.035%近辺、地銀業態から▲0.04~▲0.025%近辺の調達希望。連休前の取引という影響もあり、立ち上がりから積極的にオファーがテイクンされる地合いとなったため、朝方は▲0.03~▲0.02%のレンジが出合いの中心となった。一巡後は▲0.045~▲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。

### <レポ市場>

GC T/N(10/10-10/11)は、▲0.090~▲0.085%前後の出合い。S/N(10/11-10/12)は、▲0.095%前後の出合い。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、短国買入オペが事前予想通りの1兆円でオファーされた。応札額は3兆1,042億円と前回に引き続き多めで、結果は平均利回較差+0.003%、按分利回較差+0.002%となった。ここ数日相場が強含んで推移していたことから、利食い売りが出たものと推測される。後場も横ばい圏で推移した。出合いは3M物で▲0.172~▲0.169%、6M物で▲0.172~▲0.168%の水準でみられた。

### <CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。発行市場は、卸売、金融業態等でまとまった額の発行が行われたが、案件数は膨らまず、償還総額850億円弱に対し、発行総額は1,400億円弱となった。殆どの銘柄が0%近辺で決着する状況に変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/10/6	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.028				-	▲ 0.098	0.050	0.010	20,690.71	62.15	112.78-79	112.99-01
T/N							-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.037				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.039	0.000	▲ 0.020				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.105						
1M	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.040				-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.171	▲ 0.121						
6M							▲ 0.172	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.166	▲ 0.154						
									日付	9/29	10/2	10/3	10/4	10/5
									日銀当預残	3,691,700	3,680,600	3,688,100	3,654,100	3,633,100
									準備預金残	3,274,400	3,244,300	3,259,400	3,224,600	3,208,600
									マネタリーベース	4,747,100	4,735,400	4,742,600	4,708,300	4,688,300
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.047%	▲0.043%	▲0.035%	▲0.032%
									コール市場残高	63,980	95,852	99,460	98,591	98,318
									うち無担	50,680	74,301	77,730	76,736	77,439
									うちO/N	37,825	49,721	51,340	49,336	50,099
									うち有担	13,300	21,551	21,730	21,855	20,879

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/10/19	2018/4/19	183,019.0	10,500.01		0.0000%	5.7372%		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
国庫短期証券買入	10,000	2017/10/11			31,042	10,005	0.002		0.003	75.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/10/11			12,405	4,105	0.006		0.007	24.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/10/11			7,204	2,005	0.008		0.009	58.8
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/10/11			4,461	1,003	0.009		0.010	25.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	101,835	2017/10/6	2017/10/10		284	284		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年10月9日の予定

*体育の日	*米国祝日(Columbus Day)
-------	---------------------

## ●2017年10月10日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)	*8月の国際収支 *9月の景気ウオッチャー調査
--------------------------	----------------------------

◆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