

Central Daily Market Report

2017年10月10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10日		2017年10月11日		2017年10月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		1,000		0	
財政	▲ 25,300		900		1,000	
資金過不足	▲ 24,500		1,900		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	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			7,200		6,800	
CP等買入		▲ 500	3,000	▲ 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			800			
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	▲ 25,400		22,900		7,800	
当座預金残高	3,614,300		3,637,200		3,645,000	
準備預金残高	3,211,900					
積み終了先	3,211,700					
超過準備	3,211,700				10月11日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	402,400				積数 600	
					1日平均 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	99.98%	日数	83.33%		

●2017年10月10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9,000億円減少の321兆1,000億円(当座預金残高見込みは361兆6,000億円)。本日の無担O/N物は、地銀業態から▲0.04~▲0.02%、証券業態から▲0.04~▲0.025%近辺、都銀・信託業態から▲0.07~▲0.03%近辺の調達希望。先週のレート上昇の流れを引き継ぎ、朝方から強めのビッドが入ったため▲0.03~▲0.02%のレンジが出合いの中心となった。一方で、朝方に必要なロットを調達した後はすぐにビッドオフする先も見受けられたため、一巡後はややレート水準が低下し、▲0.05~▲0.03%のレンジの出合いで推移した。ターム物は積みの終盤に入ったことから調整ニーズも一服し、動意の薄い展開であった。

<レポ市場>

GC T/N(10/11-10/12)は、▲0.100~▲0.090%程度での出合い。S/N(10/12-10/13)は、▲0.100~▲0.095%程度での出合い。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、10Y336~348、20Y162、30Y51~56などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移。アウトライト市場は、動意なく閑散な地合いの中、3M物で▲0.174%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は、560億円程度の償還規模に対し、商社、電機業態から大型発行が見られ、発行総額は1,200億円程度となった。発行レートは引き続き0%付近での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2017/10/10	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	▲ 0.029				-	▲ 0.094	0.055	0.005	20,823.51	132.80	112.67-68	112.55-56
T/N							-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.031				-	▲ 0.103						
2W							-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.107						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.171	▲ 0.120						
6M							▲ 0.172	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.166	▲ 0.154						
									日付	10/2	10/3	10/4	10/5	10/6
									日銀当預残	3,680,600	3,688,100	3,654,100	3,633,100	3,639,700
									準備預金残	3,244,300	3,259,400	3,224,600	3,208,600	3,219,600
									マネタリーベース	4,735,400	4,742,600	4,708,300	4,688,300	4,695,500
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.043%	▲0.035%	▲0.032%	▲0.028%
									コール市場残高	95,852	99,460	98,591	98,318	104,896
									うち無担	74,301	77,730	76,736	77,439	82,931
									うちO/N	49,721	51,340	49,336	50,099	55,221
									うち有担	21,551	21,730	21,855	20,879	21,965

●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
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/10/12			4,152	703	0.002		0.004	52.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/10/12			7,769	2,803	▲0.003		▲0.001	74.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/10/12			12,562	3,008	0.002		0.004	21.6
国債買入(物価連動債)	250	2017/10/12			1,329	251	0.100		0.019	25.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	74,898	2017/10/10	2017/10/11		312	312		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,987	2017/10/10	2017/10/11		1	1		▲0.500	▲0.500	

●2017年10月11日の予定

*8月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+1.1%)	*30年利付国債入札 (8,000億円、10/13発行)
*8月の特定サービス産業動態統計速報	*エネルギー対策借入 (5,500億円、10/20借入)
*米国9月の財政収支	

◆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