

# Central Daily Market Report

2017年10月11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11日		2017年10月12日		2017年10月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100	▲700				0
財政	1,600	6,100				66,000
資金過不足	2,700	5,400				66,000
<b>金融調節</b>	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	10,000					
国債買入	7,200		6,900			
CP等買入	3,000	▲300		▲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	▲800	300		800		
当預増減	22,900		12,800			66,000
当座預金残高	3,637,200		3,650,000			3,716,000
準備預金残高	3,233,000					
積み終了先	3,232,800				10月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,232,800				積数	400
非準備預金先	404,200				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	99.99%	日数	86.67%		

## ●2017年10月11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1兆9,000億円増加の323兆円(当座預金残高見込みは363兆7,000億円)。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。昨日と同様、朝方から強めの調達希望が入ったため、立ち上がりは▲0.03~▲0.02%の出合いが中心となった。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、新しい積み期間となる16日がスタート日となる引き合いが若干見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(10/12-10/13)は、▲0.100~▲0.090%程度での出合い。S/N(10/13-10/16)は、▲0.120~▲0.100%で程度の出合い。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、10Y336~348、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は横ばいで推移した。アウトライト市場は、3M物で▲0.171%での出合いが見られたが、明日の入札を控え、全体的に様子見閑散なマーケットであった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は、1,000億円強の償還に対し、発行総額1,500億円程度の発行となった。ゴム業態・電機業態から大口の発行が見られた。発行レートに目立った変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/10/11	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	▲0.050	0.001	▲0.024				-	▲0.096	0.060	0.005	20,881.27	57.76	112.35-37	112.28-30
T/N							-	▲0.096						
S/N			▲0.030				-	-						
1W	▲0.025	▲0.015	▲0.020				-	▲0.103						
2W							-	▲0.104						
3W							-	▲0.108						
1M			0.010				-	▲0.110						
3M							▲0.171	▲0.121						
6M							▲0.172	▲0.130						
1Y							▲0.166	▲0.152						
									日付	10/3	10/4	10/5	10/6	10/10
									日銀当預残	3,688,100	3,654,100	3,633,100	3,639,700	3,614,300
									準備預金残	3,259,400	3,224,600	3,208,600	3,219,600	3,211,900
									マネタリーベース	4,742,600	4,708,300	4,688,300	4,695,500	4,669,300
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.035%	▲0.032%	▲0.028%	▲0.029%
									コール市場残高	99,460	98,591	98,318	104,896	93,907
									うち無担	77,730	76,736	77,439	82,931	73,555
									うちO/N	51,340	49,336	50,099	55,221	46,775
									うち有担	21,730	21,855	20,879	21,965	20,352

## ●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)
30年利付国債	56	0.80%	8,000	2017/10/13	2047/9/20	25,599.0	6,433.00	98.0000	0.8840%	55.0218%	98.0700	0.8810%	1,559.0
エネルギー対策	-	-	5,500	2017/10/20	2018/10/22	88,470.0	5,499.93		0.0000%	6.2169%		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)	59,316	2017/10/11	2017/10/12		697	697		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,548	2017/10/11	2017/10/12		60	60		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/10/13	2017/10/19	1.66	0	0				

## ●2017年10月12日の予定

*8月の第3次産業活動指数	*米9月の生産者物価指数	*国庫短期証券(714回)入札(3ヶ月、44,000億円、10/16発行)
*9月の企業物価指数		

◆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