

Central Daily Market Report

2017年10月12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12日		2017年10月13日		2017年10月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 300		1,000	
財政	3,300		63,500		▲ 17,000	
資金過不足	2,600		63,200		▲ 16,000	
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					1,400	▲ 2,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,900				7,100	
CP等買入		▲ 300		▲ 600		
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			700			
国債補完供給		800				
当預増減	10,000		63,300		▲ 9,800	
当座預金残高	3,647,200		3,710,500		3,700,700	
準備預金残高	3,233,500					
積み終了先	3,233,400					
超過準備	3,233,300					
非準備預金先	413,700					
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	90.00%		

●2017年10月12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8,000億円増加の323兆8,000億円(当座預金残高見込みは365兆円)。本日の無担O/N物は、地銀業態から▲0.03~▲0.015%、証券業態から▲0.04~▲0.015%近辺、都銀・信託業態から▲0.07~▲0.025%近辺の調達希望。昨日までと同様、参加者の調達意欲は強く、朝方は▲0.03~▲0.015%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、積み期間が新しくなる16日スタートのショートタームで出合いが散見された。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1,350億円(期落ち額2,250億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(10/13-10/16)は、▲0.110~▲0.090%程度での出合い。S/N(10/16-10/17)は、▲0.110~▲0.090%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は横ばいで推移した。アウトライト市場は、3M物(714回)の入札が実施された。前回債(713回)の償還日がNY市場の祝祭日に当たるため、今回の入札は海外勢の需要から、強めの結果になることも予想されていた。WI取引で▲0.1875~▲0.182%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1865%、按分落札利回▲0.1768%と、予想通りしっかりした結果となった。セカンダリーでは、▲0.18%でまとまった出合いが見られ、▲0.192~▲0.185%でも少額の出合いが見られた。この他に、6M物が▲0.174~▲0.168%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は、1,300億円弱の償還に対して、2,000億円強の発行が見られた。建設・商社・不動産業態などから大型発行が実施された。また、CP等買入オペが3,000億円度オファーされ、結果は平均落札レート▲0.003%、按分落札レート▲0.005%といずれも前回比(平均0.005%按分▲0.003%)でやや低下した。

●短期金融市場関連指標

2017/10/12	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	▲ 0.021				-	▲ 0.096	0.060	0.000	20,954.72	73.45	112.44-45	112.22-24
T/N	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.020				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.034				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.107						
1M	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.037				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.183	▲ 0.121						
6M							▲ 0.171	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.167	▲ 0.152						
									日付	10/4	10/5	10/6	10/10	10/11
									日銀当預残	3,654,100	3,633,100	3,639,700	3,614,300	3,637,200
									準備預金残	3,224,600	3,208,600	3,219,600	3,211,900	3,233,000
									マネタリーベース	4,708,300	4,688,300	4,695,500	4,669,300	4,691,100
									無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.032%	▲0.028%	▲0.029%	▲0.024%
									コール市場残高	98,591	98,318	104,896	93,907	96,044
									うち無担	76,736	77,439	82,931	73,555	74,879
									うちO/N	49,336	50,099	55,221	46,775	48,369
									うち有担	21,855	20,879	21,965	20,352	21,165

●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	714	-	44,400	2017/10/16	2018/1/22	128,937.0	35,900.70	100.0475	▲0.1768%	31.0513%	100.0501	▲0.1865%	8,499.0

●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	2017/10/16	2017/10/30		1,350	1,350				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/10/16			13,582	4,111	▲0.004		▲0.003	47.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/10/16			5,144	2,007	▲0.005		▲0.004	56.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/10/16			3,718	1,006	▲0.014		▲0.013	74.5
CP等買入	3,000	2017/10/17			6,782	2,980	▲0.005		▲0.003	84.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,193	2017/10/12	2017/10/13		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/10/12	2017/10/13		10	10		▲0.500	▲0.500	

●2017年10月13日の予定

*9月のマネーストック	*米国8月の企業在庫 *米国9月の消費者物価指数 *米国9月の小売売上高 *米国10月のミンガン大消費者信頼感指数速報	*流動性供給入札 (5,500億円、10/17発行)
-------------	----------------------------------------------------------------------	-------------------------------

◆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