

Central Daily Market Report

2017年10月16日(月)

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16日		2017年10月17日		2017年10月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		200		0	
財政	▲ 17,900		▲ 6,700		2,000	
資金過不足	▲ 17,300		▲ 6,500		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	1,400	▲ 2,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入	7,800				9,900	
CP等買入		▲ 300	3,000	▲ 100		
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	600		100			
国債補完供給	▲ 700	700		700		
当預増減	▲ 10,100		4,700		11,900	
当座預金残高	3,700,200		3,704,900		3,716,800	
準備預金残高	3,274,300					
積み終了先	2,001,400					
超過準備	834,400				10月17日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	425,900				積数	579,500
					1日平均	19,300
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額						3,019,500
準備預金進捗率	実績	80.81%	日数			3.23%

●2017年10月16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、前営業日比1兆2,000億円減少の328兆1,000億円(当座預金残高見込みは370兆円)。本日の無担O/N物は都銀・信託業態より▲0.055%、証券業態より▲0.05~▲0.04%、地銀業態より▲0.05~▲0.035%での調達となった。積み初日の取引のため取り急ぎ動きは見られず、様子見姿勢でのスタートとなった。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.04%近辺での出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(10/17-10/18)は、▲0.105~▲0.095%程度での出合い。S/N(10/18-10/19)は、▲0.14~▲0.10%程度での出合い。積み期序盤に当たることから引き続き資金調達ニーズが薄くなっており、担保確保のニーズからビッドサイドがレートを切り下げる動きが続くこととなった。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閑散ながらも、先週金曜日の買入オベの影響か、特定の銘柄に品薄感が強く、3M物が▲0.185%、6M物が▲0.18%で出合うなど、堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は商社業態から400億円とまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は650億円程度にとどまった。発行レートは横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/10/16	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	▲ 0.043				-	▲ 0.097	0.060	0.000	21,255.56	100.38	111.87-89	111.72-73
T/N							-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.039				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.109						
1M	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.030				-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.185	▲ 0.123						
6M							▲ 0.174	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.164	▲ 0.155						
									日付	10/6	10/10	10/11	10/12	10/13
									日銀当預残	3,639,700	3,614,300	3,637,200	3,647,200	3,710,300
									準備預金残	3,219,600	3,211,900	3,233,000	3,233,500	3,289,900
									マネタリーベース	4,695,500	4,669,300	4,691,100	4,701,900	4,765,100
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.029%	▲0.024%	▲0.021%	▲0.021%
									コール市場残高	104,896	93,907	96,044	96,741	97,344
									うち無担	82,931	73,555	74,879	76,182	75,987
									うちO/N	55,221	46,775	48,369	49,292	49,757
									うち有担	21,965	20,352	21,165	20,559	21,357

●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年超3年以下)	2,800	2017/10/18			11,306	2,807	0.000		0.001	81.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/10/18			14,104	3,005	▲0.002		▲0.001	27.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/10/18			17,069	4,106	▲0.004		▲0.003	18.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	84,966	2017/10/16	2017/10/17		613	613		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第78回	2017/10/20	2018/10/19	0	86
被災地金融支援オペ(熊本)	第17回	2017/10/20	2018/10/19	0	8

●2017年10月17日の予定

*米9月の鉱工業生産・設備稼働率	*20年利付国債入札
*ユーロ圏9月の消費者物価指数改定値	(10,000億円、10/19発行)
*英国9月の消費者物価指数	

◆本資料は信頼できるとさ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