# Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

#### ●資金需給

<b>●</b> 貧筮需稻							
* / + / * -	2017年1	0月17日	2017年1	0月18日	2017年10月19日		
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想		
銀行券		200		▲ 200	4	2,000	
財政	4	5, 700		1, 500	<b>1</b> 0,000		
資金過不足	4	5, 500		1, 300	<b>A</b>	12, 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							
国債買現							
国債売現							
国庫短期証買入	7, 500						
国債買入			10,000				
CP等買入	3, 000	▲ 100		▲ 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							
ETF買入	100						
国債補完供給	▲ 100	700		100			
当預増減		5, 600		11, 300		12, 000	
当 <u>座預金残高</u>		705, 800	3,	717, 100	3,	705, 100	
準 <u>備預金残高</u>		275, 000					
積み終了先		159, 700			以降の残り		
超過準備		839, 000		積数		143, 500	
非準備預金先		430, 800		1日平均		4, 900	
積み期間(10/16~	<b>~</b> 11/15)	の所要	準備額		3, 019, 500		
準備預金進捗率	実績		95. 25%	日数		6. 45%	

# ●2017年10月17日の市場動向

#### 〈インターパンク市場〉

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比3,000億円減少の327兆8,000億円(当座預金残高見込みは370兆5,000億円)。本日の無担O/N物は都銀・信託業態より▲0.055~▲0.05%、証券業態より▲0.05~▲0.04%、地銀業態より▲0.045~▲0.035%での調達で始まった。一巡後は、朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。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(10/18-10/19)は、▲0.180~▲0.160%程度での出合い。 S/N(10/19-10/20)は、▲0.190~▲0.170%程度での出合い。引き続きオファーサイドが非常に引いた水準での動きが続いており、低いレート水準での引合いに終始した。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は品薄感から大幅に低下した。アウトライト市場は、動意なく 閑散で、3M物が▲0.185%で散発的に出合う程度であった。

#### 〈CP市場〉

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は石油、商社業態からまとまった発行が見られ、総額1,650億円程度に達した。発行レートは一部銘柄で強めの出合いも見られたが、概ね横ばいで推移した。

ICD 新發10年债 口級亚均共価

# ●短期金融市場関連指標

2017/10/17	無担(速報)				有担(速報)	短国	果泉 レポレート		
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	充買参考統計值	平均値	
O/N	▲ 0.065	0.050	▲ 0.043				-	▲ 0.099	
T/N							-	▲ 0.162	
S/N							-	-	
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.034				-	▲ 0.129	
2W	▲ 0.038	0.018	▲ 0.010				-	▲ 0.124	
3W							_	▲ 0.120	
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.119	
3M							▲ 0.185	▲ 0.129	
6M							▲ 0.174	▲ 0.134	
1Y							▲ 0.161	▲ 0.157	

JGB 新光 IU 平頂				口程平均休恤					F/W/ F1			
直站	丘値	前	3比	15時時		前日比			為替(9時)	為替(17時)		
0.0	065	0.0	005	21	21,336.12		80.56		112.18-20	112.12-13		
	日付		10/	10 10/11			10/12		10/13	10/16		
日銀当	日銀当預残		3,614	300	3,637,2	00	3,647,200		3,710,300	3,700,200		
準備預	準備預金残		3,211,900		3,233,000		3,233,500		3,289,900	3,274,300		
マネタ	マネタリーベース		4,669,300		4,691,100		4,701,900		4,765,100	4,754,400		
無担O	無担O/N加重平均		▲0.029%		▲0.024%		▲0.021%		▲0.021%	▲0.043%		
コール	コール市場残高		93,907		96,044		96,741		97,344	91,372		
	うち無担		73,555		74,879		76,182		75,987	70,771		
		うち0/N	46,775		48,3	69	49,292		49,757	45,871		
うち有担		20,	352	21,165		20,559		21,357	20,601			

#### ●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 I 非価格 競争入札(億円)
20年利付国債	162	0.60%	10,000	2017/10/19	2037/9/20	32,437.0	8,001.00	100.1500	0.5910%	91.5000%	100.1700	0.5900%	1,989.0

## ●オペ結果

O I HAVI										
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)	31,000	2017/10/17	2017/10/18		78	78		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	982	2017/10/17	2017/10/18		33	33		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/10/19	2017/10/26	1.66	2	2				

### ●2017年10月18日の予定

\*櫻井日銀審議委員、 函館市金融経済懇談会にて講演 \*米国ベージュブック

\*米国9月の住宅着工件数

\*国庫短期証券(715回)入札(1年、23,000億円、10/20発行) \*交付税特別会計借入

(10,500億円、10/26借入)

- ◆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。
- ◆本資料は何ら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論見書をよくお読みください。

可以に盛りるの滅びする音画で日神元音をよくのがひんことい。 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