

# Central Daily Market Report

2017年10月18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18日		2017年10月19日		2017年10月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 1,000		▲ 2,000	
財政	2,700		▲ 8,700		▲ 11,000	
資金過不足	2,500		▲ 9,700		▲ 13,000	
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	100			▲ 100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,000				4,000	
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					100	▲ 200
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	100		400		
当預増減	12,200		▲ 9,500		▲ 9,100	
当座預金残高	3,718,000		3,708,500		3,699,400	
準備預金残高	3,280,300					
積み終了先	3,232,900					
超過準備	3,199,000					
非準備預金先	437,700					
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		97.94%		日数	
					9.68%	

## ●2017年10月18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328兆6,000億円(当座預金残高見込みは371兆7,000億円)。本日の無担O/N物は信託業態より▲0.06%、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。一巡後はビッドが薄くなり、▲0.07~▲0.05%近辺の出合いが数件見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。また、本日は3市場合同BCP訓練の一環として、固定金利方式による全店共通担保資金供給オペ(O/N物)が1,000億円オファーされ、51億円の落札結果となった。

### <レポ市場>

GC T/N(10/19-10/20)は、▲0.130~▲0.105%程度での出合い。S/N(10/20-10/23)は、▲0.125~▲0.110%程度での出合い。昨日のS/Nに比べ、ビッドが薄くなったことでT/Nは大きく水準を上げる動きとなり、その地合いを継いでS/Nも落ち着いた推移となった。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2Y379~380、5Y130~133、10Y336~348、30Y51~55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は低水準で推移した。アウトライト市場は、1Y物(715回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.16%から▲0.165%へと買い進まれる展開となる中、結果は平均落札利回▲0.1687%、按分落札利回▲0.1618%と、WI取引を反映した強めの決着となった。セカンダリーでは、▲0.171%から▲0.175%へ買い進まれるなど、強含みで推移した。一方、3M物は▲0.18%、6M物は▲0.174~▲0.172%での出合いが見られるなど、小甘く推移した。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は20日発行となり機械、電機、不動産業態等からまとまった発行が見られ、総額1,950億円程度に達した。発行レートは一部の期間が長い銘柄や発行頻度の低い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。

## ●短期金融市場関連指標

2017/10/18	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.041				-	▲ 0.105	0.065	0.000	21,363.05	26.93	112.21-22	112.50-52
T/N							-	▲ 0.109						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.119						
2W							-	▲ 0.118						
3W			▲ 0.009				-	▲ 0.116						
1M			▲ 0.048				-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.183	▲ 0.130						
6M							▲ 0.172	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.173	▲ 0.157						
									日付	10/11	10/12	10/13	10/16	10/17
									日銀当預残	3,637,200	3,647,200	3,710,300	3,700,200	3,705,800
									準備預金残	3,233,000	3,233,500	3,289,900	3,274,300	3,275,000
									マネタリーベース	4,691,100	4,701,900	4,765,100	4,754,400	4,759,800
									無担O/N加重平均	▲0.024%	▲0.021%	▲0.021%	▲0.043%	▲0.043%
									コール市場残高	96,044	96,741	97,344	91,372	90,061
									うち無担	74,879	76,182	75,987	70,771	68,854
									うちO/N	48,369	49,292	49,757	45,871	43,674
									うち有担	21,165	20,559	21,357	20,601	21,207

## ●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	715	-	23,000	2017/10/20	2018/10/22	99,654.0	18,967.9	100.1630	▲0.1618%	5.4000%	100.1700	▲0.1687%	4,032.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/10/26	2018/4/26	179,534.0	10,500.09		0.0000%	5.8486%		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
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/10/20			5,740	2,006	▲0.002		0.000	10.8
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/10/20			3,775	1,005	▲0.006		▲0.004	2.5
国債買入(変動利付債)	1,000	2017/10/20			2,234	1,000	▲0.030		▲0.216	94.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	12,045	2017/10/18	2017/10/19		415	415		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/10/18	2017/10/19		12	12		▲0.500	▲0.500	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞・即日	1,000	2017/10/18	2017/10/19		51	51				

## ●2017年10月19日の予定

*9月の貿易統計	*国庫短期証券(716回)入札 (3ヶ月、44,000億円、10/23発行)	*5年利付国債入札 (22,000億円、10/23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